

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2021年3月19日

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役会長 井澤 吉幸

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 猪浦 純子

【電話番号】 03-6703-7940

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券に係るファンドの名称】 ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー
(愛称: B R W i n)

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券の金額】 1兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

(注) 本書において文中および表中の数字は四捨五入された数値として表示されている場合があり、従って合計として表示された数字はかかる数値の総和と必ずしも一致するとは限りません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー

（ファンドの愛称を「BR Win」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

当初元本は、1口当り1円です。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額につきましては、販売会社または下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(5)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は販売会社にお問い合わせください。

（販売会社につきましては、「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）

なお、購入時手数料には消費税に相当する金額および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）が含まれています（以下同じ。）。

分配金の受取方法により、「一般コース」、「累積投資コース」の2つのコースがあります。「累積投資コース」を選択した投資者が、分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

(6)【申込単位】

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と、分配金が税引き後、無手数料で再投資される「累積投資コース」の2つの申込方法があります。

- ・一般コース：1万口以上1万口単位
- ・累積投資コース：1万円以上1円単位

ただし、「累積投資コース」を選択した投資者が収益分配金を再投資する場合は1円単位とします。なお、販売会社により上記と異なる購入時の申込単位（以下「購入単位」といいます。）を別に定める場合があります。また、取扱いを行なうコースは、各販売会社により異なります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

2021年3月20日から2021年9月17日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

当ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(9)【払込期日】

投資者は、販売会社が定める日までに、購入代金（購入受付日の翌営業日の基準価額に購入口数を乗じた金額に、購入時手数料を加算した金額をいいます。）を販売会社に支払うものとします。

振替受益権に係る各購入受付日の発行価額の総額は、販売会社によって追加信託が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

上記「(8)申込取扱場所」で払い込みください。

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

購入代金の利息

購入代金には利息をつけません。

日本以外の地域における発行

行ないません。

購入不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても購入は受付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度とは、

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。
- ・ファンドの設定、換金、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」（ファンドの愛称を「BR Win」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行ないます。

当ファンドは、追加型証券投資信託であり、追加型投信／海外／債券に属しています。下記は、一般社団法人投資信託協会の「商品分類に関する指針」に基づき当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

<商品分類表>

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産（ ） 資産複合

<属性区分表>

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 不動産投信 その他資産 (投資信託証券(債券)) 資産複合 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回(毎月) 日々 その他	グローバル (日本を含む) 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東(中東) エマージング	ファミリー ファンド ファンド・オブ・ ファンズ	あり () なし

<各分類および区分の定義>

・商品分類

単位型投信・追加型 投信の区分	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
投資対象地域による 区分	海外	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資対象資産による 区分	債券	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

・属性区分

投資対象資産による 属性区分	その他資産（投資信託証券（債券））	目論見書又は投資信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいう。ただし、当ファンドは、投資信託証券を通じて主として債券に投資する。
決算頻度による属性 区分	年12回（毎月）	目論見書又は投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。
投資対象地域による 属性区分	グローバル （日本を含む）	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資形態による属性 区分	ファンド・オブ・ ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
為替ヘッジによる属 性区分	為替ヘッジなし	目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいう。なお、「為替ヘッジ」とは、対円で為替リスクに対するヘッジの有無をいう。

上記は、一般社団法人投資信託協会の定義を基に委託会社が作成したものを含まず。なお、上記以外の商品分類・属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

信託金の限度額は、5,000億円です。ただし、委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの特色

- a. 主として、先進国の国債および投資適格債、先進国の高利回り社債（ハイ・イールド債）、エマージング諸国の債券等、世界の公社債を主要な投資対象とし、ブラックロック・グループの運用会社が運用する投資信託証券に投資します。副次的な投資対象として、一部を優先証券、転換社債、株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）に投資を行なう投資信託証券を含みます。

主要投資対象ファンドの投資対象

<p>先進国の 国債・政府機関債</p> <p>先進国の 政府または政府機関等により 発行される債券</p>	<p>エマージング諸国のソブリン債</p> <p>エマージング諸国の政府等により 発行される債券</p>	<p>先進国の地方債</p> <p>先進国の地方自治体により 発行される債券</p>
<p>資産担保証券 (ABS、MBS等)</p> <p>クレジットカード債権、 自動車ローン、住宅ローン債権等を 裏付けとして発行される債券</p>	<p>投資適格社債</p> <p>企業等により発行される 債券のうち信用格付けが高い (BBB格以上)とされる債券</p>	<p>ハイ・イールド債</p> <p>信用格付けが低く(BB格相当以下 もしくは格付けされていない)、 価格変動のリスクが大きい分、 高い利回りが期待される債券</p>

主要投資対象ファンドにおいては、各セクターへの投資割合に制限を設けません。したがって、資産担保証券についても投資適格・非投資適格にかかわらず相当割合の投資を行なうことができます。また、投資する資産担保証券の中には収益率向上のためデリバティブ取引等を活用するものも含まれます。資産担保証券への投資に伴う「期限前償還リスク」、「デリバティブ取引のリスク」、その他当ファンドにかかる投資リスクについては後述の投資リスクの記載の内容をご確認ください。主要投資対象ファンドの投資対象は今後変更となることがあります。

主要投資対象ファンドの投資アプローチ

特定の市場指数にとらわれないアクティブかつフレキシブルな運用により、収益率の向上、インカム収入の獲得を目指します。

■柔軟性の高い運用

- ・セクター間の相関や各市場に対する運動性に配慮し、価格変動を抑え、魅力的な収益率やインカム収入の確保を目指します。
- ・償還年限、セクター、地域配分、通貨配分等に制約を設けず、運用チームの判断による柔軟な運用を目指します。

■リスクコントロール

- ・投資しているセクターにおけるリスクを様々な面からモニターします。デリバティブ取引等を利用し、リスクコントロールを行ないます。

※上記は主要投資対象ファンドにおける投資アプローチを説明するものです。将来変更される可能性があります。

- b. 投資対象とする投資信託証券（以下「投資対象ファンド」ということがあります。）は以下の通りです。
- ・ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ投資証券(ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」といいます。)
 - ・ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券(ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」といいます。)
- 投資対象ファンドは、委託会社の判断により、変更することがあります。

c．当ファンドはファンド・オブ・ファンズ形式で運用します。

各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況環境および投資対象ファンドの収益性等を勘案して委託会社が決定します。通常、BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券）への投資比率を高位に保ちます。

d．原則として、毎月分配を行いません。

毎月20日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行ない、分配金をお支払いします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないことがあります。

【イメージ図】



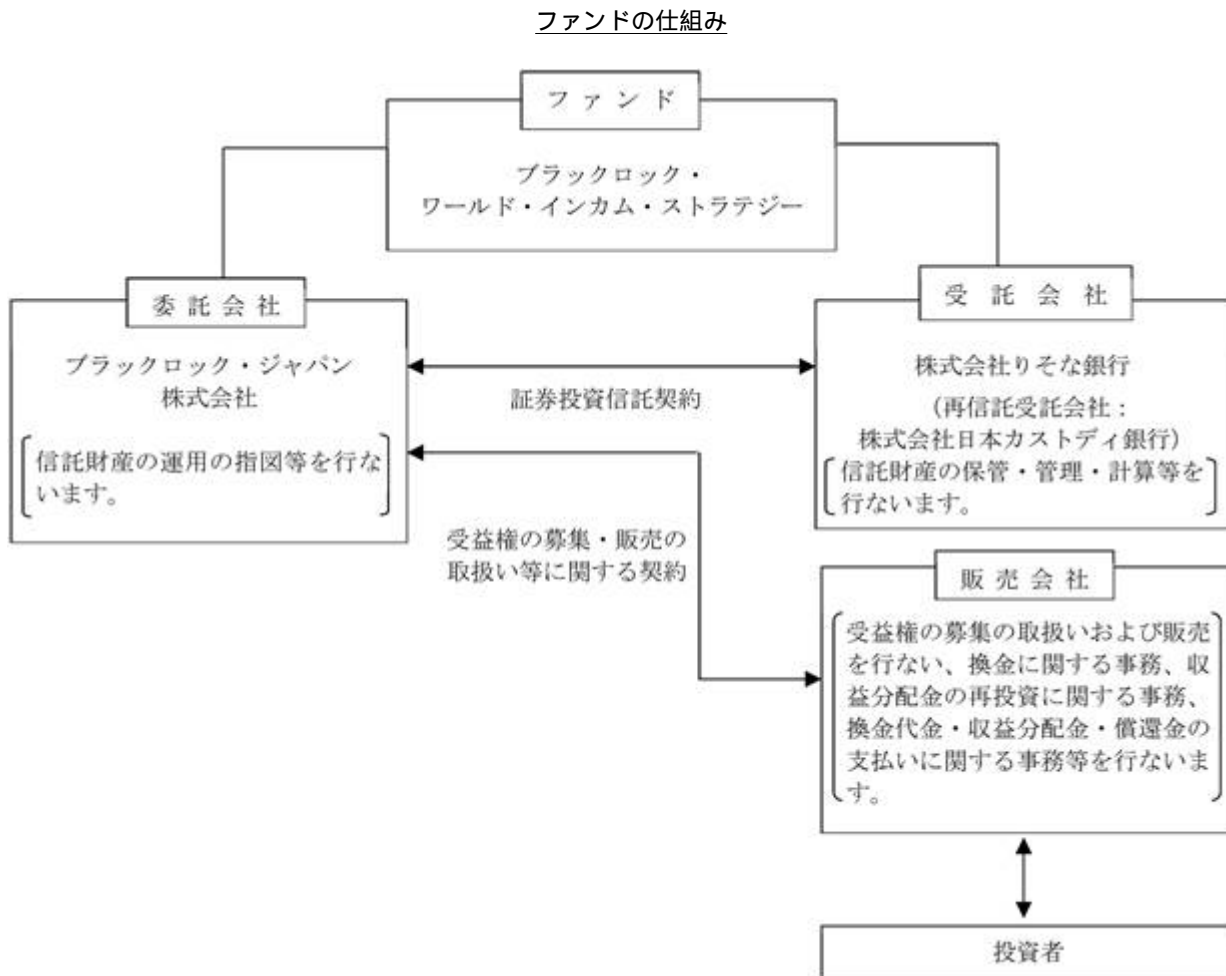
※上図はイメージであり、将来の分配金のお支払いおよび金額について示唆、保証するものではありません。

e．外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

(2) 【ファンドの沿革】

2005年7月7日	信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
2006年10月1日	ファンド名称を変更 「メリルリンチ・ワールド・インカム・ストラテジー」から「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」へ変更
2007年1月4日	投資信託振替制度への移行
2009年12月2日	ファンドの委託会社としての業務をブラックロック・ジャパン株式会社からパークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社（新社名：ブラックロック・ジャパン株式会社）に承継

(3) 【ファンドの仕組み】



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

ファンドの設定・運営に関する事項、信託財産の運用・管理に関する事項、委託会社および受託会社の業務に関する事項、投資者に関する事項等について規定しています。

b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

委託会社が販売会社に委託する受益権の募集販売の取扱い、換金事務、投資者に対する収益分配金および換金代金の支払い、その他これらの業務に付随する業務等について規定しています。

< ファンド・オブ・ファンズの仕組み >

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



< 委託会社の概況 >

2020年12月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a . 資本金 3,120百万円

b . 沿革

1985年1月	メリルリンチ投資顧問株式会社 （後のメリルリンチ・インベストメント・マネジャーズ株式会社）設立 1987年3月 証券投資顧問業者として登録 1987年6月 投資一任業務認可を取得 1997年12月 投資信託委託業務免許を取得
1988年3月	パークレイズ・デズート・ウェッド投資顧問株式会社 （後のパークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社）設立 1988年6月 証券投資顧問業者として登録 1989年1月 投資一任業務認可を取得 1998年3月 投資信託委託業務免許を取得
1999年4月	野村ブラックロック・アセット・マネジメント株式会社 （後のブラックロック・ジャパン株式会社）設立 1999年6月 証券投資顧問業者として登録 1999年8月 投資一任業務認可を取得
2006年10月	メリルリンチ・インベストメント・マネジャーズ株式会社を存続会社として、 ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 新会社商号：「ブラックロック・ジャパン株式会社」
2009年12月	パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社を存続会社として、 ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 新会社商号：「ブラックロック・ジャパン株式会社」

c . 大株主の状況

株主名	住所	所有 株式数	所有比率
ブラックロック・ジャパン・ ホールディングス合同会社	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号	15,000株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主として、先進国の国債および投資適格債、先進国の高利回り社債（ハイ・イールド債）、エマージング諸国の債券等、世界の公社債を主要な投資対象とし、ブラックロック・グループの運用会社が運用する投資信託証券に投資します。副次的な投資対象として、一部を優先証券、転換社債、株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）に投資を行なう投資信託証券を含みます。投資対象とする投資信託証券は別に定めるものとします。

各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況動向および各投資信託証券の収益性等を勘案して委託会社が決定します。通常、ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券への投資比率を高位に保ちます。

別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

投資対象ファンドの選定にあたっては、上記の投資方針の他、当ファンドの運営上の効率性等を勘案します。

委託会社は、自己または第三者の利益を図るために投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引を行ないまたは行なうことがある場合、投資者の利益を害しないことを確保するため、売買執行管理規程等の社内規程により管理します。

(2)【投資対象】

投資対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律（以下「投信法」といいます。）第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

- a．有価証券
- b．金銭債権
- c．約束手形（手形割引市場において売買される手形に限ります。）

投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として別に定める投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）および投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- a．国債証券
- b．短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）第66条第1号に規定する短期社債、保険業法第61条の10第1項に規定する短期社債、資産の流動化に関する法律第2条第8項に関する特定短期社債、信用金庫法第54条の4第1項に規定する短期債および農林中央金庫法第62条の2第1項に規定する短期農林債をいいます。）
- c．コマーシャル・ペーパー
- d．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- e．外国法人が発行する譲渡性預金証書

投資対象とする金融商品

この信託の設定、換金、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図ができます。

- a．預金
- b．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- c．コール・ローン
- d．手形割引市場において売買される手形

投資対象ファンドの概要

投資方針における「別に定める投資信託証券」の概要は以下の通りです。

- (a) BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券）

形態	ルクセンブルグ籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）
投資目的および投資態度	<p>ファンドはトータル・リターンを最大化を目指します。ファンドは、少なくとも純資産の70%を世界各国の政府、政府関連機関、企業が様々な通貨建てで発行する譲渡性のある債券に投資をします。非投資適格債を含むあらゆる種別の有価証券を投資対象とし、これらを有効利用します。通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。</p> <p>また、ファンドは、投資適格、非投資適格に係わらず、資産担保証券（ABS、MBS）に純資産の100%を上限として投資を行なうことができます。</p> <p>なお、ファンドは中国の規制により許容される方法により、中国本土に流通する債券に純資産の20%を上限として投資することができます。</p>
設定日	2007年1月31日
存続期間	無期限
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。
管理報酬	ありません。（注）
その他費用	保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として8月末日）に決算を行ないます。
収益分配方針	毎月（原則として毎月末営業日）に分配を行ないます。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド、ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク、ブラックロック（シンガポール）リミテッド（副投資顧問会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（オーストラリア）リミテッド）
保管会社	ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー/エヌ・ブイ

（注） 投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

(b) BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

形態	ルクセンブルグ籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）
投資目的および投資態度	純資産総額の80%以上を投資適格債に投資し、トータル・リターンを最大化することを目指します。純資産総額の70%以上をデュレーションが5年未満の米ドル建て投資適格債に投資し、ファンドの平均デュレーションは3年以下を原則とします。 通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。
設定日	2002年10月31日
存続期間	無期限
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・ 純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。
管理報酬	ありません。（注）
その他費用	保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として8月末日）に決算を行いません。
収益分配方針	分配を行いません。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク （副投資顧問会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（オーストラリア）リミテッド）
保管会社	ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー／エヌ・ブイ

（注） 投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

(3) 【運用体制】

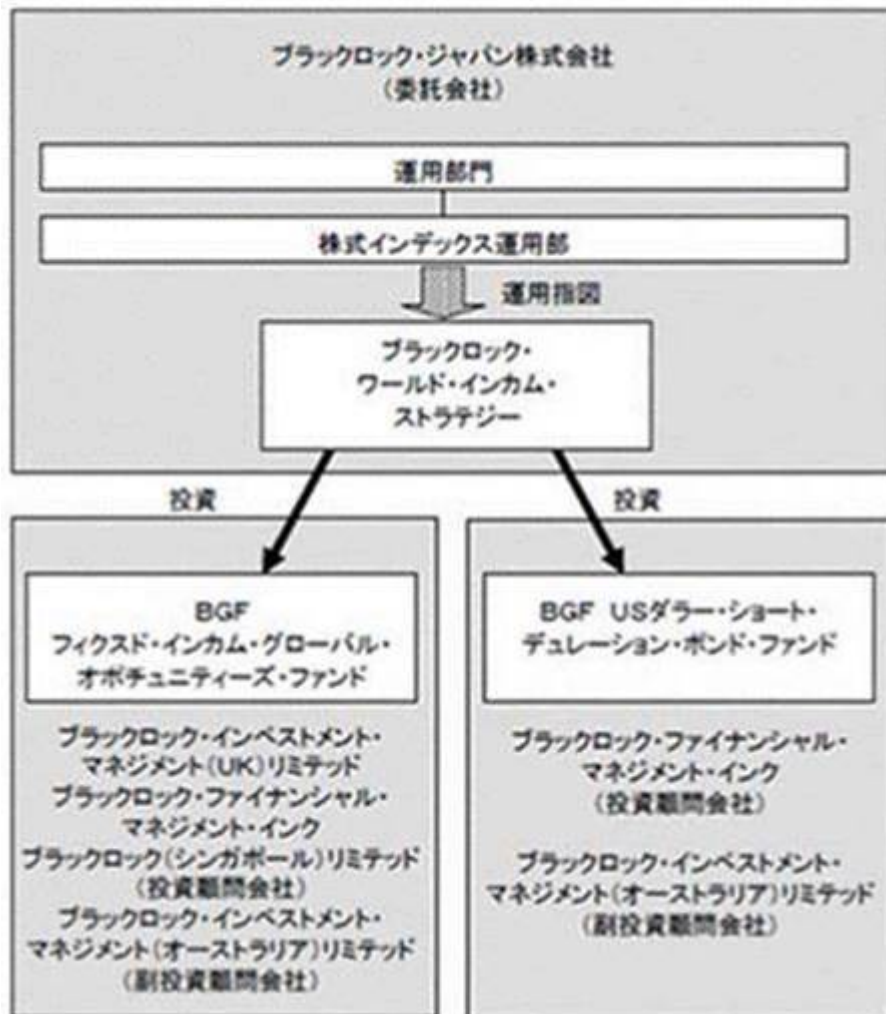
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

社内には内部監査を担当する部門、ファンドの運用状況やリスク状況等をモニターし関連部署にフィードバックする部門、或いは投資委員会等開催により、各ファンドの投資方針等にしながら運用が行なわれているか確認する組織、機能が確立しています。

当ファンドの運用は、株式インデックス運用部（当ファンド担当：8名程度）が担当いたします。

運用体制図



運用体制等は、変更となる場合があります。

<参考：主要投資対象ファンドの運用体制>

ブラックロック・グループのファンダメンタル債券運用部門によって運用されます。

ポートフォリオ・マネジャーが協調しながら運用にあたる「チーム運用体制」を取っています。

基本戦略は、週次で行なわれる2つのインベストメント・ストラテジー・ミーティング（投資戦略会議）が中核となっています。マーケット・アウトルック・ミーティングには全ての債券運用プロフェッショナルが参加し、各セクター・チームにて事前に開催するチーム・ミーティングによって導き出された見解を、各チームのリード・マネジャーが発表します。次に、全チームのリード・マネジャーおよびリスク・クオンツ分析部門の代表者が参加するポートフォリオ・ストラテジー・ミーティングにおいて、セクター配分、ポートフォリオのリスク、投資テーマ等について議論を行ないます。

各ポートフォリオ・チームは、運用を担当するポートフォリオにとって適切と考える金利リスク、期限前償還リスク、利回りカーブ・リスク、信用リスク、流動性バイアス、およびセクター・アロケーションをそれぞれ独自に決定しますが、ポートフォリオ・ストラテジー・ミーティングでは各ポートフォリオ・チームの投資アイデアを共有することを主な目的とします。

ファンダメンタル債券運用部門は、セクター・チームと協働して、ポートフォリオの投資目的およびガイドラインを遵守しつつ、銘柄選択、タイミング、売買執行において、チームのレラティブ・バリューによる見通しをポートフォリオに反映します。ファンダメンタル債券運用部門は投資方針を策定し、その投資方針に基づいてセクター・スペシャリストが売買を執行します。投資テーマについては、週次で開催されるミーティングで定期的に議論かつ継続的に議論され、必要に応じて修正されます。



ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約8.68兆ドル（約896兆円）を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、当社はその日本法人です。

当グループは、世界各国の機関投資家および個人投資家のため、株式、債券、キャッシュ・マネジメントおよびオルタナティブ商品といった様々な資産クラスの運用を行なっております。また、機関投資家向けに、リスク管理、投資システム・アウトソーシングおよびファイナンシャル・アドバイザー・サービスの提供を行なっております。

* 2020年12月末現在。(円換算レートは1ドル=103.245円を使用)

(4)【分配方針】

収益分配方針

月1回の毎決算時(原則として毎月20日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行ないます。

a. 分配対象額の範囲

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額とします。

b. 分配対象収益についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

c. 留保益の運用方針

留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。

収益の分配

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

(a) 配当金、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、諸費用(消費税に相当する金額および地方消費税に相当する金額(以下「消費税等相当額」といいます。))を含みます。以下同じ。)、信託報酬(消費税等相当額を含みます。以下同じ。)を控除した後、その残額を投資者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

(b) 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、諸費用および信託報酬を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、投資者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越すものとします。

収益分配金の支払い

a. 支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として5営業日以内)に、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者にお支払いを開始します。収益分配金は販売会社の営業所等において支払います。

(b) 累積投資コースの場合

委託会社は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を販売会社に交付します。販売会社は累積投資契約^{*}に基づき、投資者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売り付けを行ないます。

^{*} 当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

b. 時効

投資者が、a.(a)に規定する支払開始日から5年間支払い請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

収益分配金に関する留意事項

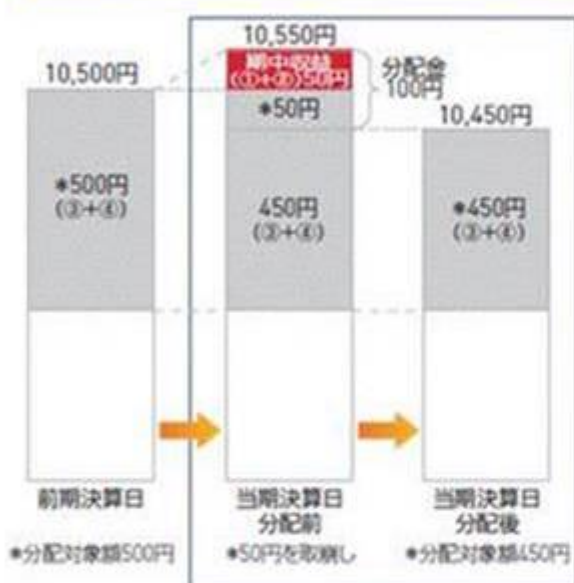
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



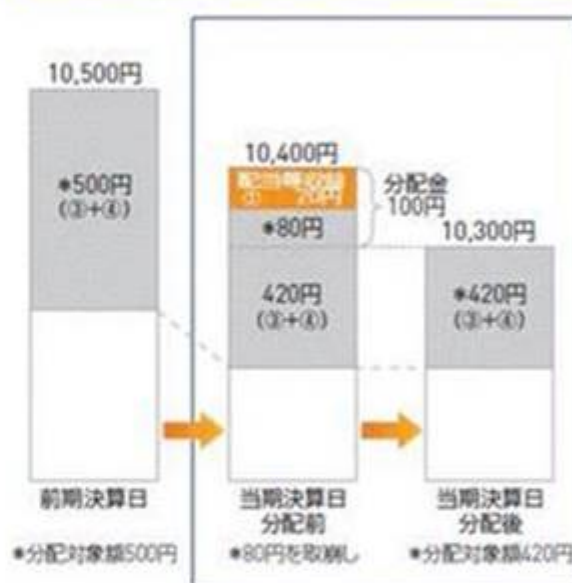
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合

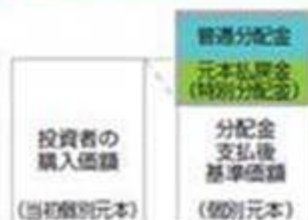


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※ 上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないしすべてが、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より計算期間中の基準価額の値上がり幅が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

※普通分配金に対する課税については、後記「手続手数料等」の「ファンドの費用・税金」をご参照ください。

(5) 【投資制限】

当ファンドの約款で定める投資制限です。

投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外への直接投資は行ないません。

投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資制限

約款および定款等においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得される（販売会社および運用会社が一時取得する場合を含みます。）投資信託証券であることが記載されていない同一銘柄の投資信託証券への投資割合は信託財産の純資産総額の50%以内とします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により、特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約の指図および範囲

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、換金に伴う支払資金の手当て（換金に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- b. 換金に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の換金代金入金日までの間もしくは投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却または換金代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信用リスク集中回避のための投資制限

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行ないます。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組入れられている有価証券の値動きの他、為替変動による影響を受けます。これらの信託財産の運用によりに生じた損益はすべて投資者の皆様へ帰属します。したがって、当ファンドは元金および元金からの収益の確保が保証されているものではなく、基準価額の下落により投資者は損失を被り、元金を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。当ファンドにかかる主なリスクは以下の通りです。

基準価額の変動要因

a．金利変動リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、世界の債券に投資します。政治、経済、社会情勢等の影響により金利が上昇すれば債券の価格は下落し、金利が低下すれば債券の価格は上昇します。したがって、金利の変動が当ファンドの運用成果に影響を与えます。

b．信用リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、世界の債券に投資します。投資した債券の発行体の財務状況により、債務不履行が生じることがあります。債務不履行が生じた場合には、当ファンドの運用成果に影響を与えます。また、債券の外部格付の変更により債券の価格が変動することがあり、それに伴い当ファンドの運用成果に影響を与えます。

当ファンドの投資対象ファンドは、信用格付が低い、または格付されていない公社債に純資産の相当部分を投資することができます。これらの種類の証券はより高い利回りを提供する可能性があるものの、格付が比較的高い証券に比べてより投機的であり、価格の変動がより激しく、債券投資の元本や金利収入を脅かすリスクも大きくなります。

c．期限前償還リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、MBS、CMBS、ABS等（資産担保証券）の期限前償還リスクを伴う債券へ投資することができます。一般的に金利が低下した場合、資産担保証券の期限前償還が増加することにより、事前に見込まれた収益をあげることができず、さらに利回りの低い証券に再投資せざるを得ない可能性があります。これらの要因が当ファンドの運用成果に影響を与えます。

d．為替変動リスク

当ファンドは、外貨建ての投資信託証券を投資対象とします。当該投資信託証券に対して為替ヘッジを行いません。また、当ファンドの投資対象ファンドは、外貨建資産に投資を行いません。したがって、為替レートの変動が当ファンドの運用成果に影響を与えます。

e．カントリー・リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、エマージング（新興）市場の発行体が発行する公社債にも投資します。エマージング諸国の経済は、先進諸国に比べて不安定であり、その市場を取り巻く社会的・経済的環境はより不透明な場合が多く、エマージング諸国の政府は自国経済を規制または監督する上で大きな影響力を行使することがあります。したがって、主として先進国市場に投資する場合に比べて、投資先の国の政治・経済事情、通貨・資本規制等の要因により、より大幅に公社債の価格が変動することが考えられ、それに伴い当ファンドの運用成果に影響を与えます。

f．デリバティブ取引のリスク

当ファンドの投資対象ファンドは、先物・オプション取引などのデリバティブ取引を用いることができます。また、当ファンドの主要投資対象ファンドが投資する資産担保証券においてデリバティブ取引が用いられることがあります。このような投資手法は現物資産への投資に代わって運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による影響から投資対象ファンドを守るために用いられます。デリバティブ取引を用いた結果、取引コストと投資元本を脅かすリスクが伴い、当ファンドの運用成果に影響を与えます。また、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

ファンド運営上のリスク

a．購入および換金の受付の中止・取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の購入および換金の受付を中止する場合があります。また、この場合、既に受付けた受益権の購入および換金の受付を取り消す場合があります。

b．ファンドの繰上償還

当ファンドは換金により受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合、または投資者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情が発生したとき等は、ファンドを償還させる場合があります。

c．法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(2) リスクの管理体制

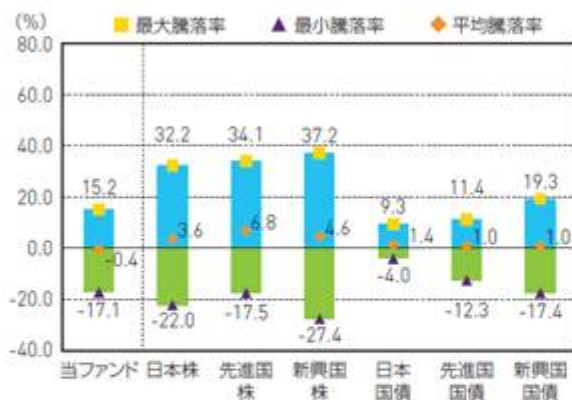
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2016年1月～2020年12月)



※上記グラフは、2016年1月～2020年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドについては、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国国債…J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(2016年1月～2020年12月)



※上記グラフは、2016年1月～2020年12月の5年間の各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

<各指数について>

東証株価指数(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄を対象に時価総額を指数として算出したものです。東証株価指数(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株)東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。

MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発、計算した株価指数です。MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)は日本を除く世界の主要先進国の株式を、また、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は新興国の株式を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表している指数で、日本国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。同指数に関する知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行なわれるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、新興国の現地通貨建ての国債を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳細は販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています（以下同じ。）。

購入時手数料は、購入時の商品説明、販売に関する事務手続き等の役務の対価として販売会社にお支払いいただくものです。

分配金の受取方法により、「一般コース」、「累積投資コース」の2つのコースがあります。「累積投資コース」を選択した投資者が分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.584%（税抜1.44%）の率を乗じて得た金額とします。信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

	信託報酬の配分	役務の内容
委託会社	年0.715% (税抜0.65%)	ファンドの運用、基準価額の計算、運用報告書等各種書類の作成等
販売会社	年0.825% (税抜0.75%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等
受託会社	年0.044% (税抜0.04%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等

投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

信託報酬は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

委託会社および販売会社に対する信託報酬は、ファンドから委託会社に対して支弁されます。信託報酬の販売会社への配分は、ファンドから委託会社に支弁された後、委託会社より販売会社に対して支払われます。受託会社の報酬は、ファンドから受託会社に対して支弁されます。

(4)【その他の手数料等】

信託財産において換金代金等の支払資金に不足が生じるときに資金借入れの指図を行なった場合はその都度、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、投資者の負担とし、その都度、信託財産中から支弁します。

下記の諸費用（以下「諸費用」といいます）および諸費用に係る消費税等相当額は、投資者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。

- 1．受益権の管理事務に関連する費用
- 2．有価証券届出書、有価証券報告書等法定提出書類の作成、印刷および提出に係る費用
- 3．目論見書の作成、印刷および交付に係る費用
- 4．信託約款の作成、印刷および届出に係る費用
- 5．運用報告書の作成、印刷、交付および提出に係る費用
- 6．公告に係る費用ならびに信託約款の変更またはファンドの償還に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
- 7．この信託の監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用

委託会社は、年0.11%（税抜0.10%）を上限とする、上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する率を毎日純資産総額に対して乗じて得た額、または上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する額を、上記の諸費用の支払の合計額とみなして、ファンドから受領することができます。諸費用および諸費用に係る消費税等相当額は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われるものとします。

外貨建資産の保管等に要する費用^{*}等は、その都度、信託財産中より支弁します。

^{*} 海外における保管銀行等に支払う有価証券の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用

投資対象ファンドに係る保管報酬および事務処理に要する諸費用が別途投資対象ファンドから支払われます。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

日本の居住者（法人を含む。）である投資者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

個別元本方式について

- a．追加型株式投資信託について、投資者毎の信託時の受益権の価額等（購入時手数料は含まれません。）が当該投資者の元本（「個別元本」といいます。）にあたります。
- b．投資者が同一ファンドの受益権を複数回購入した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- c．同一ファンドを複数の販売会社で購入する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行なわれません。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを購入する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行なわれる場合があります。
- d．投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記「収益分配金の課税について」を参照。）

換金時および償還時の課税について

- a．個人の投資者の場合
換金時および償還時の差益（譲渡益）が課税対象となります。
- b．法人の投資者の場合
換金時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

個人、法人の課税の取扱いについて

a．個人の投資者に対する課税

(a) 収益分配金の課税について

支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。原則として、申告は不要です。

また、確定申告を行なうことにより総合課税（配当控除なし）と申告分離課税（20.315%（所得税15.315%、地方税5%））のいずれかを選択することができます。

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

換金時および償還時の差益（換金価額および償還価額から購入費用（購入時手数料および当該購入時手数料にかかる消費税等相当額を含みます。）を控除した利益）は、譲渡益として課税対象（譲渡所得等）となり、20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）の利用が可能な場合があります。

換金時および償還時に損失（譲渡損）が生じた場合には、確定申告することで、他の株式等の譲渡益、上場株式等の配当所得および特定公社債等の利子所得の金額（申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。

また、換金時および償還時の差益（譲渡益）については、他の株式等の譲渡損と損益を相殺することができます。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、NISAの口座では、特定口座や一般口座で生じた配当所得および譲渡所得との損益通算はできません。非課税の対象となる金額、期間等を含めて詳しくは販売会社にお問い合わせください。

b．法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%、地方税の源泉徴収はありません。）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、当ファンドについては、法人税の課税対象となりますが、益金不算入制度の適用はありません。

外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2020年12月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下の運用状況は2020年12月末現在のものです。

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

(1)【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	1,555,960,697	99.04
内 ルクセンブルグ	1,555,960,697	99.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15,082,423	0.96
純資産総額	1,571,043,120	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国/ 地域	種類	投資口数	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドクラスJ投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	1,399,057	1,098.18	1,536,418,747	1,100.20	1,539,250,144	97.98
2	ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	10,034	1,664.27	16,700,166	1,665.31	16,710,553	1.06

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.04

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

2020年12月末現在、同日前1年以内における各月末および直近20特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第12特定期間	第64期(2011年1月20日)	7,099,765,359	7,109,923,367	0.6989	0.6999
	第65期(2011年2月21日)	6,740,300,864	6,749,866,393	0.7046	0.7056
	第66期(2011年3月22日)	6,459,285,013	6,468,682,205	0.6874	0.6884
	第67期(2011年4月20日)	6,064,782,117	6,073,395,050	0.7041	0.7051
	第68期(2011年5月20日)	5,829,780,579	5,838,139,774	0.6974	0.6984
	第69期(2011年6月20日)	5,472,705,804	5,480,744,958	0.6808	0.6818
第13特定期間	第70期(2011年7月20日)	5,194,094,232	5,201,873,380	0.6677	0.6687
	第71期(2011年8月22日)	4,982,537,926	4,990,074,175	0.6611	0.6621
	第72期(2011年9月20日)	4,825,687,355	4,833,044,388	0.6559	0.6569
	第73期(2011年10月20日)	4,726,461,704	4,733,673,067	0.6554	0.6564
	第74期(2011年11月21日)	4,597,750,464	4,604,774,306	0.6546	0.6556
	第75期(2011年12月20日)	4,628,803,830	4,635,786,108	0.6629	0.6639
第14特定期間	第76期(2012年1月20日)	4,628,516,959	4,635,490,459	0.6637	0.6647
	第77期(2012年2月20日)	4,764,021,111	4,770,915,024	0.6910	0.6920
	第78期(2012年3月21日)	4,945,408,372	4,952,229,483	0.7250	0.7260
	第79期(2012年4月20日)	4,740,779,337	4,747,487,380	0.7067	0.7077
	第80期(2012年5月21日)	4,565,667,725	4,572,339,900	0.6843	0.6853
	第81期(2012年6月20日)	4,508,864,540	4,515,457,272	0.6839	0.6849
第15特定期間	第82期(2012年7月20日)	4,530,795,123	4,537,310,005	0.6955	0.6965
	第83期(2012年8月20日)	4,554,045,114	4,560,532,884	0.7019	0.7029
	第84期(2012年9月20日)	4,533,139,157	4,539,595,130	0.7022	0.7032
	第85期(2012年10月22日)	4,545,170,896	4,551,531,577	0.7146	0.7156
	第86期(2012年11月20日)	4,600,052,086	4,606,374,386	0.7276	0.7286
	第87期(2012年12月20日)	4,846,349,125	4,852,659,951	0.7679	0.7689
第16特定期間	第88期(2013年1月21日)	5,163,561,913	5,169,840,531	0.8224	0.8234
	第89期(2013年2月20日)	4,608,502,510	4,613,908,223	0.8525	0.8535
	第90期(2013年3月21日)	4,184,944,067	4,189,773,939	0.8665	0.8675
	第91期(2013年4月22日)	4,228,972,916	4,233,613,081	0.9114	0.9124
	第92期(2013年5月20日)	4,344,332,667	4,348,918,128	0.9474	0.9484
	第93期(2013年6月20日)	3,945,101,538	3,949,642,330	0.8688	0.8698
第17特定期間	第94期(2013年7月22日)	3,776,413,408	3,780,629,135	0.8958	0.8968
	第95期(2013年8月20日)	3,675,699,022	3,679,854,311	0.8846	0.8856
	第96期(2013年9月20日)	3,572,183,774	3,576,180,836	0.8937	0.8947
	第97期(2013年10月21日)	3,495,530,548	3,499,496,967	0.8813	0.8823
	第98期(2013年11月20日)	3,535,169,009	3,539,090,680	0.9014	0.9024
	第99期(2013年12月20日)	3,534,080,557	3,537,815,885	0.9461	0.9471
第18特定期間	第100期(2014年1月20日)	3,514,700,010	3,518,420,799	0.9446	0.9456
	第101期(2014年2月20日)	3,333,120,710	3,336,709,422	0.9288	0.9298
	第102期(2014年3月20日)	3,309,975,047	3,313,526,405	0.9320	0.9330
	第103期(2014年4月21日)	3,319,759,900	3,323,292,914	0.9396	0.9406
	第104期(2014年5月20日)	3,287,975,525	3,291,503,617	0.9319	0.9329
	第105期(2014年6月20日)	3,230,793,962	3,234,230,168	0.9402	0.9412

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第19特定期間	第106期(2014年7月22日)	3,091,663,347	3,094,963,055	0.9370	0.9380
	第107期(2014年8月20日)	2,922,432,284	2,925,515,852	0.9477	0.9487
	第108期(2014年9月22日)	2,906,995,848	2,912,806,105	1.0006	1.0026
	第109期(2014年10月20日)	2,835,004,527	2,840,817,697	0.9754	0.9774
	第110期(2014年11月20日)	3,047,787,148	3,053,430,342	1.0802	1.0822
	第111期(2014年12月22日)	3,058,187,286	3,063,781,248	1.0934	1.0954
第20特定期間	第112期(2015年1月20日)	3,002,013,111	3,007,608,381	1.0731	1.0751
	第113期(2015年2月20日)	2,929,559,332	2,934,928,132	1.0913	1.0933
	第114期(2015年3月20日)	2,867,615,806	2,872,793,102	1.1078	1.1098
	第115期(2015年4月20日)	2,819,136,164	2,824,310,941	1.0896	1.0916
	第116期(2015年5月20日)	2,888,833,190	2,894,070,137	1.1033	1.1053
	第117期(2015年6月22日)	3,000,457,396	3,005,863,383	1.1100	1.1120
第21特定期間	第118期(2015年7月21日)	2,918,007,772	2,923,197,074	1.1246	1.1266
	第119期(2015年8月20日)	3,026,468,578	3,031,911,931	1.1120	1.1140
	第120期(2015年9月24日)	2,913,790,409	2,919,231,076	1.0711	1.0731
	第121期(2015年10月20日)	2,781,230,978	2,786,452,181	1.0654	1.0674
	第122期(2015年11月20日)	2,863,610,850	2,868,850,506	1.0931	1.0951
	第123期(2015年12月21日)	2,828,383,868	2,833,669,401	1.0702	1.0722
第22特定期間	第124期(2016年1月20日)	2,723,110,213	2,728,407,951	1.0280	1.0300
	第125期(2016年2月22日)	2,562,948,245	2,568,192,861	0.9774	0.9794
	第126期(2016年3月22日)	2,531,544,368	2,536,750,608	0.9725	0.9745
	第127期(2016年4月20日)	2,363,085,461	2,368,056,126	0.9508	0.9528
	第128期(2016年5月20日)	2,380,314,677	2,385,285,544	0.9577	0.9597
	第129期(2016年6月20日)	2,235,938,659	2,240,853,941	0.9098	0.9118
第23特定期間	第130期(2016年7月20日)	2,318,637,912	2,323,619,489	0.9309	0.9329
	第131期(2016年8月22日)	2,202,719,547	2,207,683,608	0.8875	0.8895
	第132期(2016年9月20日)	2,203,052,536	2,207,976,757	0.8948	0.8968
	第133期(2016年10月20日)	2,234,897,644	2,239,799,071	0.9119	0.9139
	第134期(2016年11月21日)	2,280,133,521	2,284,832,847	0.9704	0.9724
	第135期(2016年12月20日)	2,378,370,666	2,383,007,837	1.0258	1.0278
第24特定期間	第136期(2017年1月20日)	2,345,704,373	2,350,332,348	1.0137	1.0157
	第137期(2017年2月20日)	2,223,820,787	2,228,289,084	0.9954	0.9974
	第138期(2017年3月21日)	2,191,165,925	2,195,583,001	0.9921	0.9941
	第139期(2017年4月20日)	2,021,218,544	2,025,426,520	0.9607	0.9627
	第140期(2017年5月22日)	2,049,029,165	2,053,204,866	0.9814	0.9834
	第141期(2017年6月20日)	1,923,838,255	1,927,733,743	0.9877	0.9897
第25特定期間	第142期(2017年7月20日)	1,751,647,392	1,755,183,621	0.9907	0.9927
	第143期(2017年8月21日)	1,694,543,009	1,698,050,221	0.9663	0.9683
	第144期(2017年9月20日)	1,678,331,145	1,681,718,526	0.9909	0.9929
	第145期(2017年10月20日)	1,652,233,908	1,655,536,528	1.0006	1.0026
	第146期(2017年11月20日)	1,588,029,359	1,591,236,903	0.9902	0.9922
	第147期(2017年12月20日)	1,596,544,272	1,599,736,181	1.0004	1.0024
第26特定期間	第148期(2018年1月22日)	1,507,949,613	1,511,000,100	0.9887	0.9907
	第149期(2018年2月20日)	1,463,089,728	1,466,167,490	0.9507	0.9527
	第150期(2018年3月20日)	1,450,640,831	1,453,732,320	0.9385	0.9405
	第151期(2018年4月20日)	1,471,975,699	1,475,085,877	0.9466	0.9486
	第152期(2018年5月21日)	1,506,549,465	1,509,660,796	0.9684	0.9704
	第153期(2018年6月20日)	1,476,791,897	1,479,878,953	0.9568	0.9588

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第27特定期間	第154期(2018年7月20日)	1,505,204,680	1,508,289,741	0.9758	0.9778
	第155期(2018年8月20日)	1,450,503,874	1,453,536,322	0.9567	0.9587
	第156期(2018年9月20日)	1,493,518,221	1,496,599,091	0.9695	0.9715
	第157期(2018年10月22日)	1,458,466,849	1,461,487,394	0.9657	0.9677
	第158期(2018年11月20日)	1,419,628,883	1,422,577,205	0.9630	0.9650
	第159期(2018年12月20日)	1,571,272,396	1,574,554,228	0.9576	0.9596
第28特定期間	第160期(2019年1月21日)	1,573,860,687	1,577,219,906	0.9370	0.9390
	第161期(2019年2月20日)	1,607,828,729	1,611,202,149	0.9532	0.9552
	第162期(2019年3月20日)	1,652,695,868	1,656,126,642	0.9635	0.9655
	第163期(2019年4月22日)	1,797,871,043	1,801,571,397	0.9717	0.9737
	第164期(2019年5月20日)	1,785,780,207	1,789,524,700	0.9538	0.9558
	第165期(2019年6月20日)	1,821,290,712	1,825,152,093	0.9433	0.9453
第29特定期間	第166期(2019年7月22日)	1,836,069,064	1,839,933,710	0.9502	0.9522
	第167期(2019年8月20日)	1,805,072,782	1,808,919,672	0.9385	0.9405
	第168期(2019年9月20日)	1,827,834,682	1,831,684,936	0.9495	0.9515
	第169期(2019年10月21日)	1,756,210,870	1,759,896,442	0.9530	0.9550
	第170期(2019年11月20日)	1,778,667,655	1,782,397,419	0.9538	0.9558
	第171期(2019年12月20日)	1,761,494,563	1,765,148,656	0.9641	0.9661
第30特定期間	第172期(2020年1月20日)	1,784,825,600	1,788,480,365	0.9767	0.9787
	第173期(2020年2月20日)	1,802,381,006	1,806,010,696	0.9931	0.9951
	第174期(2020年3月23日)	1,574,240,198	1,577,749,073	0.8973	0.8993
	第175期(2020年4月20日)	1,595,635,917	1,599,094,529	0.9227	0.9247
	第176期(2020年5月20日)	1,602,094,600	1,605,555,871	0.9257	0.9277
	第177期(2020年6月22日)	1,617,172,884	1,620,637,956	0.9334	0.9354
第31特定期間	第178期(2020年7月20日)	1,642,151,355	1,645,623,123	0.9460	0.9480
	第179期(2020年8月20日)	1,618,039,078	1,621,467,601	0.9439	0.9459
	第180期(2020年9月23日)	1,587,777,596	1,591,178,078	0.9339	0.9359
	第181期(2020年10月20日)	1,574,559,931	1,577,915,086	0.9386	0.9406
	第182期(2020年11月20日)	1,564,473,101	1,567,830,925	0.9318	0.9338
	第183期(2020年12月21日)	1,566,109,052	1,569,458,866	0.9350	0.9370
	2019年12月末現在	1,767,231,903		0.9665	
	2020年1月末現在	1,772,348,586		0.9690	
	2020年2月末現在	1,707,468,853		0.9727	
	2020年3月末現在	1,544,424,525		0.8931	
	2020年4月末現在	1,582,687,743		0.9145	
	2020年5月末現在	1,613,269,075		0.9315	
	2020年6月末現在	1,632,346,063		0.9415	
	2020年7月末現在	1,592,896,202		0.9280	
	2020年8月末現在	1,606,562,692		0.9378	
	2020年9月末現在	1,594,299,961		0.9384	
	2020年10月末現在	1,554,469,890		0.9259	
	2020年11月末現在	1,566,052,777		0.9350	
	2020年12月末現在	1,571,043,120		0.9372	

【分配の推移】

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第12特定期間	第64期	0.0010
	第65期	0.0010
	第66期	0.0010
	第67期	0.0010
	第68期	0.0010
	第69期	0.0010
第13特定期間	第70期	0.0010
	第71期	0.0010
	第72期	0.0010
	第73期	0.0010
	第74期	0.0010
	第75期	0.0010
第14特定期間	第76期	0.0010
	第77期	0.0010
	第78期	0.0010
	第79期	0.0010
	第80期	0.0010
	第81期	0.0010
第15特定期間	第82期	0.0010
	第83期	0.0010
	第84期	0.0010
	第85期	0.0010
	第86期	0.0010
	第87期	0.0010
第16特定期間	第88期	0.0010
	第89期	0.0010
	第90期	0.0010
	第91期	0.0010
	第92期	0.0010
	第93期	0.0010
第17特定期間	第94期	0.0010
	第95期	0.0010
	第96期	0.0010
	第97期	0.0010
	第98期	0.0010
	第99期	0.0010
第18特定期間	第100期	0.0010
	第101期	0.0010
	第102期	0.0010
	第103期	0.0010
	第104期	0.0010
	第105期	0.0010
第19特定期間	第106期	0.0010
	第107期	0.0010
	第108期	0.0020
	第109期	0.0020
	第110期	0.0020
	第111期	0.0020
第20特定期間	第112期	0.0020
	第113期	0.0020
	第114期	0.0020
	第115期	0.0020
	第116期	0.0020
	第117期	0.0020
第21特定期間	第118期	0.0020
	第119期	0.0020
	第120期	0.0020
	第121期	0.0020
	第122期	0.0020
	第123期	0.0020

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第22特定期間	第124期	0.0020
	第125期	0.0020
	第126期	0.0020
	第127期	0.0020
	第128期	0.0020
	第129期	0.0020
第23特定期間	第130期	0.0020
	第131期	0.0020
	第132期	0.0020
	第133期	0.0020
	第134期	0.0020
	第135期	0.0020
第24特定期間	第136期	0.0020
	第137期	0.0020
	第138期	0.0020
	第139期	0.0020
	第140期	0.0020
	第141期	0.0020
第25特定期間	第142期	0.0020
	第143期	0.0020
	第144期	0.0020
	第145期	0.0020
	第146期	0.0020
	第147期	0.0020
第26特定期間	第148期	0.0020
	第149期	0.0020
	第150期	0.0020
	第151期	0.0020
	第152期	0.0020
	第153期	0.0020
第27特定期間	第154期	0.0020
	第155期	0.0020
	第156期	0.0020
	第157期	0.0020
	第158期	0.0020
	第159期	0.0020
第28特定期間	第160期	0.0020
	第161期	0.0020
	第162期	0.0020
	第163期	0.0020
	第164期	0.0020
	第165期	0.0020
第29特定期間	第166期	0.0020
	第167期	0.0020
	第168期	0.0020
	第169期	0.0020
	第170期	0.0020
	第171期	0.0020
第30特定期間	第172期	0.0020
	第173期	0.0020
	第174期	0.0020
	第175期	0.0020
	第176期	0.0020
	第177期	0.0020
第31特定期間	第178期	0.0020
	第179期	0.0020
	第180期	0.0020
	第181期	0.0020
	第182期	0.0020
	第183期	0.0020

【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率(%)
第12特定期間	第64期	1.5
	第65期	1.0
	第66期	2.3
	第67期	2.6
	第68期	0.8
	第69期	2.2
第13特定期間	第70期	1.8
	第71期	0.8
	第72期	0.6
	第73期	0.1
	第74期	0.0
	第75期	1.4
第14特定期間	第76期	0.3
	第77期	4.3
	第78期	5.1
	第79期	2.4
	第80期	3.0
	第81期	0.1
第15特定期間	第82期	1.8
	第83期	1.1
	第84期	0.2
	第85期	1.9
	第86期	2.0
	第87期	5.7
第16特定期間	第88期	7.2
	第89期	3.8
	第90期	1.8
	第91期	5.3
	第92期	4.1
	第93期	8.2
第17特定期間	第94期	3.2
	第95期	1.1
	第96期	1.1
	第97期	1.3
	第98期	2.4
	第99期	5.1
第18特定期間	第100期	0.1
	第101期	1.6
	第102期	0.5
	第103期	0.9
	第104期	0.7
	第105期	1.0
第19特定期間	第106期	0.2
	第107期	1.2
	第108期	5.8
	第109期	2.3
	第110期	10.9
	第111期	1.4
第20特定期間	第112期	1.7
	第113期	1.9
	第114期	1.7
	第115期	1.5
	第116期	1.4
	第117期	0.8
第21特定期間	第118期	1.5
	第119期	0.9
	第120期	3.5
	第121期	0.3
	第122期	2.8
	第123期	1.9

特定期間	計算期間	収益率(%)
第22特定期間	第124期	3.8
	第125期	4.7
	第126期	0.3
	第127期	2.0
	第128期	0.9
	第129期	4.8
第23特定期間	第130期	2.5
	第131期	4.4
	第132期	1.0
	第133期	2.1
	第134期	6.6
	第135期	5.9
第24特定期間	第136期	1.0
	第137期	1.6
	第138期	0.1
	第139期	3.0
	第140期	2.4
	第141期	0.8
第25特定期間	第142期	0.5
	第143期	2.3
	第144期	2.8
	第145期	1.2
	第146期	0.8
	第147期	1.2
第26特定期間	第148期	1.0
	第149期	3.6
	第150期	1.1
	第151期	1.1
	第152期	2.5
	第153期	1.0
第27特定期間	第154期	2.2
	第155期	1.8
	第156期	1.5
	第157期	0.2
	第158期	0.1
	第159期	0.4
第28特定期間	第160期	1.9
	第161期	1.9
	第162期	1.3
	第163期	1.1
	第164期	1.6
	第165期	0.9
第29特定期間	第166期	0.9
	第167期	1.0
	第168期	1.4
	第169期	0.6
	第170期	0.3
	第171期	1.3
第30特定期間	第172期	1.5
	第173期	1.9
	第174期	9.4
	第175期	3.1
	第176期	0.5
	第177期	1.0
第31特定期間	第178期	1.6
	第179期	0.0
	第180期	0.8
	第181期	0.7
	第182期	0.5
	第183期	0.6

(注) 収益率とは、計算期間末の基準価額(分配の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配の額。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数です。

(4)【設定及び解約の実績】

特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第12特定期間	第64期	5,601,819	471,251,409	10,158,008,175
	第65期	5,496,284	597,974,968	9,565,529,491
	第66期	503,609,038	671,945,971	9,397,192,558
	第67期	5,663,077	789,922,129	8,612,933,506
	第68期	4,611,140	258,349,047	8,359,195,599
	第69期	4,949,469	324,990,364	8,039,154,704
第13特定期間	第70期	4,473,201	264,479,896	7,779,148,009
	第71期	4,418,716	247,316,861	7,536,249,864
	第72期	4,349,087	183,565,518	7,357,033,433
	第73期	4,368,375	150,037,906	7,211,363,902
	第74期	4,214,820	191,736,692	7,023,842,030
	第75期	78,238,723	119,801,796	6,982,278,957
第14特定期間	第76期	4,026,217	12,804,218	6,973,500,956
	第77期	4,013,535	83,600,619	6,893,913,872
	第78期	3,898,297	76,700,593	6,821,111,576
	第79期	3,582,088	116,649,681	6,708,043,983
	第80期	3,566,513	39,435,029	6,672,175,467
	第81期	3,864,403	83,307,511	6,592,732,359
第15特定期間	第82期	3,545,128	81,394,732	6,514,882,755
	第83期	3,473,000	30,585,116	6,487,770,639
	第84期	3,446,269	35,243,421	6,455,973,487
	第85期	3,452,479	98,744,853	6,360,681,113
	第86期	7,416,555	45,796,857	6,322,300,811
	第87期	3,564,657	15,038,546	6,310,826,922
第16特定期間	第88期	3,015,074	35,223,575	6,278,618,421
	第89期	2,744,790	875,649,572	5,405,713,639
	第90期	1,622,495	577,464,051	4,829,872,083
	第91期	56,914,015	246,620,601	4,640,165,497
	第92期	43,088,121	97,792,574	4,585,461,044
	第93期	35,159,285	79,827,431	4,540,792,898
第17特定期間	第94期	1,512,360	326,577,670	4,215,727,588
	第95期	1,444,530	61,882,577	4,155,289,541
	第96期	34,217,565	192,444,545	3,997,062,561
	第97期	12,535,405	43,176,041	3,966,419,925
	第98期	1,497,780	46,246,055	3,921,671,650
	第99期	94,541,717	280,884,882	3,735,328,485
第18特定期間	第100期	19,488,243	34,027,554	3,720,789,174
	第101期	16,078,535	148,155,518	3,588,712,191
	第102期	12,423,450	49,777,022	3,551,358,619
	第103期	1,221,589	19,565,482	3,533,014,726
	第104期	53,519,669	58,441,461	3,528,092,934
	第105期	1,265,383	93,152,251	3,436,206,066
第19特定期間	第106期	1,231,953	137,729,565	3,299,708,454
	第107期	1,144,037	217,283,597	3,083,568,894
	第108期	1,136,709	179,576,779	2,905,128,824
	第109期	1,940,114	483,849	2,906,585,089
	第110期	2,081,007	87,068,940	2,821,597,156
	第111期	54,873,218	79,489,321	2,796,981,053
第20特定期間	第112期	1,707,713	1,053,303	2,797,635,463
	第113期	21,387,974	134,623,116	2,684,400,321
	第114期	5,384,936	101,137,169	2,588,648,088
	第115期	11,984,979	13,244,118	2,587,388,949
	第116期	68,718,931	37,634,305	2,618,473,575
	第117期	116,507,272	31,986,995	2,702,993,852
第21特定期間	第118期	23,805,200	132,147,917	2,594,651,135
	第119期	134,631,396	7,605,751	2,721,676,780
	第120期	5,392,817	6,735,845	2,720,333,752
	第121期	2,000,769	111,732,815	2,610,601,706
	第122期	45,259,938	36,033,529	2,619,828,115
	第123期	42,455,385	19,516,849	2,642,766,651

特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第22特定期間	第124期	9,188,478	3,085,927	2,648,869,202
	第125期	4,148,748	30,709,801	2,622,308,149
	第126期	7,308,447	26,496,225	2,603,120,371
	第127期	2,342,690	120,130,150	2,485,332,911
	第128期	2,030,731	1,929,774	2,485,433,868
	第129期	2,023,627	29,816,402	2,457,641,093
第23特定期間	第130期	34,403,560	1,255,876	2,490,788,777
	第131期	2,139,407	10,897,657	2,482,030,527
	第132期	2,298,361	22,218,045	2,462,110,843
	第133期	2,269,566	13,666,830	2,450,713,579
	第134期	2,201,905	103,251,998	2,349,663,486
	第135期	2,073,542	33,151,141	2,318,585,887
第24特定期間	第136期	2,008,917	6,606,817	2,313,987,987
	第137期	12,510,213	92,349,438	2,234,148,762
	第138期	1,931,772	27,542,490	2,208,538,044
	第139期	2,003,384	106,553,410	2,103,988,018
	第140期	1,968,778	18,105,815	2,087,850,981
	第141期	2,301,229	142,407,972	1,947,744,238
第25特定期間	第142期	2,405,582	182,035,113	1,768,114,707
	第143期	2,173,034	16,681,610	1,753,606,131
	第144期	2,447,603	62,362,805	1,693,690,929
	第145期	1,720,400	44,100,907	1,651,310,422
	第146期	2,467,791	50,005,896	1,603,772,317
	第147期	1,684,895	9,502,483	1,595,954,729
第26特定期間	第148期	2,620,049	73,331,252	1,525,243,526
	第149期	20,492,766	6,854,860	1,538,881,432
	第150期	6,863,252		1,545,744,684
	第151期	12,600,986	3,256,338	1,555,089,332
	第152期	13,019,597	12,443,194	1,555,665,735
	第153期	6,757,660	18,895,041	1,543,528,354
第27特定期間	第154期	1,520,868	2,518,683	1,542,530,539
	第155期	2,523,420	28,829,809	1,516,224,150
	第156期	26,234,878	2,023,647	1,540,435,381
	第157期	1,583,740	31,746,269	1,510,272,852
	第158期	1,517,491	37,628,983	1,474,161,360
	第159期	198,343,463	31,588,377	1,640,916,446
第28特定期間	第160期	79,034,742	40,341,196	1,679,609,992
	第161期	7,100,270		1,686,710,262
	第162期	29,344,531	667,493	1,715,387,300
	第163期	159,526,725	24,736,827	1,850,177,198
	第164期	22,070,503	932	1,872,246,769
	第165期	104,913,835	46,469,726	1,930,690,878
第29特定期間	第166期	1,653,449	21,324	1,932,323,003
	第167期	1,621,547	10,499,501	1,923,445,049
	第168期	1,772,570	90,572	1,925,127,047
	第169期	1,783,314	84,124,204	1,842,786,157
	第170期	22,483,380	387,455	1,864,882,082
	第171期	1,586,403	39,421,574	1,827,046,911
第30特定期間	第172期	1,501,915	1,166,200	1,827,382,626
	第173期	1,829,400	14,366,903	1,814,845,123
	第174期	1,408,185	61,815,586	1,754,437,722
	第175期	1,373,625	26,505,312	1,729,306,035
	第176期	1,339,736	9,784	1,730,635,987
	第177期	1,910,792	10,744	1,732,536,035
第31特定期間	第178期	3,543,598	195,529	1,735,884,104
	第179期	1,375,485	22,997,979	1,714,261,610
	第180期	1,830,669	15,851,258	1,700,241,021
	第181期	1,348,777	24,012,126	1,677,577,672
	第182期	1,399,236	64,732	1,678,912,176
	第183期	1,324,009	5,329,080	1,674,907,105

(参考情報)

運用実績

2020年12月末現在

基準価額・純資産の推移



※ 基準価額および分配金再投資基準価額は信託報酬控除後の値です。信託報酬等については、後述の「ファンドの費用」をご覧ください。

※ 分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

分配の推移

設定来累計		4,420円
直近1年間累計		240円
第179期	2020年8月	20円
第180期	2020年9月	20円
第181期	2020年10月	20円
第182期	2020年11月	20円
第183期	2020年12月	20円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

主要な資産の状況

資産構成比率



※ 比率は対純資産総額。
四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

組入上位10銘柄*(%)

	銘柄名	比率
1	TREASURY (CPI) NOTE 0.5 04/15/2024	1.9
2	CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT 1.99 04/09/2025	1.2
3	ITALY (REPUBLIC OF) 2.45 09/01/2050	1.2
4	TREASURY NOTE 1.5 08/31/2021	1.1
5	CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT 2.85 06/04/2027	1.0
6	INDIA (REPUBLIC OF) 7.26 01/14/2029	1.0
7	TREASURY NOTE 1.5 09/30/2021	0.9
8	FNMA 30YR 2019 PRODUCTION	0.8
9	INDONESIA (REPUBLIC OF) 7 09/15/2030	0.8
10	GREECE REPUBLIC OF (GOVERNMENT) 1.5 06/18/2030	0.7

債券種別構成比率*(%)

債券	比率
現金等	31.49
新興国債	23.47
証券化商品	18.04
派生商品合計	13.29
ハイ・イールド債	9.61
国債	8.69
投資適格社債	7.76
地方債	1.8

※ 主要投資対象ファンドはデリバティブ取引を活用するため、合計が100%を超える場合があります。

通貨構成比率*(%)

通貨	比率
米国・ドル	90.1
中国・人民元	6.2
インドルピー	1.6
ユーロ	1.3
英国・ポンド	0.9
その他	3.3
カナダドル	-0.3
南アフリカ・ランド	-0.5
オフショア・人民元	-2.6

※ 当ファンドの主要投資対象ファンドである「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」の運用状況です。
比率はBGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドの純資産総額に対する割合。

年間収益率の推移

※ ファンドの収益率は、決算時の分配金を非課税で再投資したものととして算出しています。

※ 当ファンドにはベンチマークはありません。



※ 運用実績・データ等は作成日現在および過去のものであり、今後の運用成果を保証するものではありません。

※ ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページにて開示しております。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

受益権の投資者は、販売会社と有価証券の取引に関する契約を締結します。販売会社は有価証券の取引にかかわる約款を投資者に交付し、投資者は当該約款に基づく取引口座の設定を申込み旨の申込書を提出します。

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と分配金が税引き後無手数料で再投資される「累積投資コース」の2つの申込方法があります。

「累積投資コース」を選択する投資者は、当該販売会社との間で「累積投資約款^{*}」にしたがって契約を締結します。

^{*} 当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

取り扱いを行なうコースは各販売会社により異なりますので、詳細は販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

投資者は販売会社に、購入と同時にまたはあらかじめ当該投資者が受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該投資者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該購入の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該投資者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

(2) 申込期間

当ファンドの購入は、申込期間における販売会社の各営業日に、販売会社の本・支店、営業所等でお受けしています。なお、申込期間は、有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(3) 受付時間

購入の受付は、申込期間中の午後3時までに受付けたものを当日のお申込みとします。受付時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとします。ただし、受付時間は販売会社により異なることがあります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(4) 購入不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても購入は受け付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(5) 購入単位

- ・一般コース　　：1万口以上1万口単位
- ・累積投資コース：1万円以上1円単位

ただし、「累積投資コース」を選択した投資者が収益分配金を再投資する場合は1円単位とします。なお、販売会社により上記と異なる購入単位を別に定める場合があります。また、取り扱いを行なうコースは、各販売会社により異なります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(6) 購入価額

受益権の購入価額は、購入受付日の翌営業日の基準価額とします。なお、購入価額には購入時手数料は含まれておりません。

(7) 購入時手数料

- a．購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は販売会社にお問い合わせください。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

- b．累積投資契約に基づく収益分配金の再投資は無手数料となります。

(8) 購入代金のお支払い

受益権の投資者は、販売会社が定める日までに購入代金（購入受付日の翌営業日の基準価額に購入口数を乗じた金額に、購入時手数料（消費税等相当額を含みます。）を加算した金額をいいます。）を販売会社に支払うものとします。

(9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社の判断により、受益権の購入の受付を中止することおよび既に受付けた購入の受付を取り消すことがあります。

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に以下の単位をもって換金の申込をすることができます。なお、販売会社により下記と異なる換金単位を別に定める場合があります。また、取り扱いを行なうコースは、各販売会社により異なります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

- ・一般コース：1万口以上1万口単位
- ・累積投資コース：1口以上1口単位

投資者が換金の申込をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。換金の申込の受付は、午後3時までとなっております。ただし、受付時間は販売会社により異なる場合があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。受付時間を過ぎての換金の申込は翌営業日の取扱とします。

(2) 換金不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても換金は受け付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(3) 換金価額

換金価額は、換金受付日の翌営業日の基準価額とします。なお手取額は、換金価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

当ファンドの換金価額等につきましては販売会社または下記に問い合わせることにより知ることができます。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

(4) 換金受付の制限

信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口の換金の申込には制限があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(5) 換金代金の支払い

換金代金は原則として換金受付日から起算して5営業日目から販売会社においてお支払いします。

(6) 換金の受付中止および取消

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付を中止することおよび既に受付けた換金の受付を取り消すことができます。換金の受付が中止された場合には、投資者は当該受付中止以前に行なった当日の換金の申込を撤回できます。ただし、投資者がその換金の申込を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金を受け付けたものとします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

当ファンドにおいて基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当り）は委託会社の営業日に毎日算出されます。投資者は、販売会社または下記に問い合わせることにより知ることができます。

また、日々の基準価額（1万口当り）は翌日の日本経済新聞に掲載されております。ファンド名は「Win」と省略されて記載されております。

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

投資信託証券：金融商品取引所（海外取引所を含む）に上場されているものは、当該取引所における計算日の最終相場（海外取引所に上場されているものについては、計算日に知りうる直近の最終相場）で評価します。金融商品取引所に上場されていないものは、第一種金融商品取引業者、銀行等の提示する価格（原則として、計算日に知りうる直近の日の純資産価格）で評価します。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

この信託の期間は、無期限とします。

(4)【計算期間】

計算期間は毎月21日から翌月20日までとすることを原則とします。計算期間終了日に該当する日が休業日のときは該当日の翌営業日を計算期間の終了日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

- a．委託会社は、信託期間中において、当ファンドを償還することが投資者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、換金により、受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- c．a．およびb．の場合において、委託会社は、この事項について、あらかじめ償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる投資者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d．c．の公告および書面には、投資者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e．d．の一定の期間内に異議を述べた投資者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、a．およびb．のファンドの償還を行いません。
- f．委託会社は、当ファンドの償還をしないこととしたときは、償還しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる投資者に対して交付します。ただし、全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- g．d．～f．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、d．の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
- h．委託会社は、監督官庁より当ファンドの償還の命令を受けたときはその命令にしたがい、ファンドを償還させます。
- i．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドを償還させます。
- j．i．にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更d．」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- k．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または投資者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドを償還させます。

信託約款の変更

- a．委託会社は、投資者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる投資者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c．b．の公告および書面には、投資者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d．c．の一定の期間内に異議を述べた投資者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、信託約款の変更を行いません。
- e．委託会社は、この信託約款の変更を行わないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる投資者に対して交付します。ただし、全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- f．委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときはa．～e．の規定にしがたがいます。

運用報告書の作成

毎年6月および12月の決算時および償還時に、委託会社が期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「交付運用報告書」を作成し、購入いただいた販売会社からあらかじめお申し出いただいた方法にて知れている受益者にお届けいたします。

信託事務の委託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

関係法人との契約の更改等に関する手続

「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は1年とし、委託会社、販売会社いずれからも別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様です。

公告

委託会社が投資者に対してする公告は日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

投資者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて委託会社から受領する権利を有します。

<一般コース>

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として5営業日以内）に毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において換金が行なわれた受益権にかかる投資者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）にお支払いを開始します。

投資者が、収益分配金について支払開始日から5年間支払い請求を行なわない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

<累積投資コース>

受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が販売会社に支払われます。

販売会社は、累積投資契約に基づき、投資者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行ないます。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金受領権

投資者は、委託会社の決定した償還金を、持ち分に応じて委託会社から受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日以内）に償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（償還日以前において換金が行なわれた受益権にかかる投資者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）にお支払いを開始します。なお、当該投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

償還金の支払いは、販売会社において行ないます。

投資者が、償還金について支払開始日から10年間支払いの請求を行なわない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属するものとし、

(3) 受益権の換金請求権

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に換金を請求する権利を有します。

換金代金は、換金受付日から起算して、原則として5営業日目から投資者に支払います。

換金の請求を行なう投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該投資者の請求に係る当ファンドの換金を委託会社が行なうのと引き換えに、当該換金に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

(4) 反対者の買取請求権

ファンドの償還または信託約款の変更を行なう場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた投資者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(5) 帳簿書類の閲覧又は謄写の請求権

投資者は、委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)及び同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2020年6月23日から2020年12月21日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前特定期間末 (2020年6月22日現在)	当特定期間末 (2020年12月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	6	6
金銭信託	19,784,584	10,277,295
投資証券	1,603,337,741	1,517,289,516
派生商品評価勘定	-	3,245
未収入金	-	44,151,800
流動資産合計	1,623,122,331	1,571,721,862
資産合計	1,623,122,331	1,571,721,862
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,465,072	3,349,814
未払解約金	-	911
未払受託者報酬	64,522	58,748
未払委託者報酬	2,258,541	2,056,455
その他未払費用	161,312	146,882
流動負債合計	5,949,447	5,612,810
負債合計	5,949,447	5,612,810
純資産の部		
元本等		
元本	1,732,536,035	1,674,907,105
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	115,363,151	108,798,053
(分配準備積立金)	188,226,660	172,807,104
元本等合計	1,617,172,884	1,566,109,052
純資産合計	1,617,172,884	1,566,109,052
負債純資産合計	1,623,122,331	1,571,721,862

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前特定期間 (自 2019年12月21日 至 2020年6月22日)	当特定期間 (自 2020年6月23日 至 2020年12月21日)
営業収益		
受取配当金	23,585,841	21,158,224
受取利息	2,617	65
有価証券売買等損益	6,610,792	66,685,112
為替差損益	33,561,343	50,692,799
営業収益合計	16,583,677	37,150,602
営業費用		
受託者報酬	371,459	350,652
委託者報酬	13,002,458	12,274,232
その他費用	1,238,389	1,173,903
営業費用合計	14,612,306	13,798,787
営業利益又は営業損失()	31,195,983	23,351,815
経常利益又は経常損失()	31,195,983	23,351,815
当期純利益又は当期純損失()	31,195,983	23,351,815
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	471,974	134,071
期首剰余金又は期首欠損金()	65,552,348	115,363,151
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,524,924	4,100,149
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,524,924	4,100,149
剰余金減少額又は欠損金増加額	489,485	657,371
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	489,485	657,371
分配金	21,178,285	20,363,566
期末剰余金又は期末欠損金()	115,363,151	108,798,053

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における特定期間末日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

(3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則としてわが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建資産・負債の円換算については原則として、わが国における特定期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

4 収益及び費用の計上基準

(1) 受取配当金の計上基準

受取配当金は原則として、投資証券の配当落ち日に予想配当金額を計上し、入金金額との差額についてはそれぞれ入金時に計上しております。

(2) 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 外貨建資産等の会計処理

外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

(2) 特定期間末日の取扱い

当特定期間は前特定期間末及び当特定期間末が休業日であったため、2020年6月23日から2020年12月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前特定期間末 (2020年6月22日現在)	当特定期間末 (2020年12月21日現在)
1 当該特定期間の末日における受益権総数	1,732,536,035口	1,674,907,105口
2 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 115,363,151円	元本の欠損 108,798,053円
3 1口当たり純資産額	0.9334円	0.9350円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前特定期間 (自 2019年12月21日 至 2020年 6月22日)
分配金の計算過程	<p>第172期計算期間(2019年12月21日～2020年 1月20日)</p> <p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,217,387円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(203,494,870円)、分配準備積立金(201,768,928円)により、分配対象収益は409,481,185円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,654,765円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第173期計算期間(2020年 1月21日～2020年 2月20日)</p> <p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,551,784円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(202,299,901円)、分配準備積立金(200,742,314円)により、分配対象収益は407,593,999円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,629,690円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第174期計算期間(2020年 2月21日～2020年 3月23日)</p> <p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,512,876円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(195,718,596円)、分配準備積立金(194,800,409円)により、分配対象収益は392,031,881円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,508,875円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第175期計算期間(2020年 3月24日～2020年 4月20日)</p> <p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,693,319円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(193,064,994円)、分配準備積立金(189,892,456円)により、分配対象収益は386,650,769円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,458,612円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第176期計算期間(2020年 4月21日～2020年 5月20日)</p> <p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,724,746円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(193,360,783円)、分配準備積立金(190,126,089円)により、分配対象収益は386,211,618円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,461,271円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第177期計算期間(2020年 5月21日～2020年 6月22日)</p> <p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,303,341円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(193,783,018円)、分配準備積立金(189,388,391円)により、分配対象収益は385,474,750円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,465,072円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

項目	当特定期間 (自 2020年6月23日 至 2020年12月21日)
分配金の計算過程	<p>第178期計算期間(2020年6月23日～2020年7月20日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,295,962円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(194,546,101円)、分配準備積立金(188,205,445円)により、分配対象収益は386,047,508円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,471,768円(1万口当たり20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第179期計算期間(2020年7月21日～2020年8月20日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,234,888円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(192,269,807円)、分配準備積立金(185,540,382円)により、分配対象収益は379,045,077円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,428,523円(1万口当たり20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第180期計算期間(2020年8月21日～2020年9月23日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益(603,454円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(190,892,186円)、分配準備積立金(181,652,827円)により、分配対象収益は373,148,467円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,400,482円(1万口当たり20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第181期計算期間(2020年9月24日～2020年10月20日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,121,133円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(188,487,756円)、分配準備積立金(176,331,789円)により、分配対象収益は367,940,678円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,355,155円(1万口当たり20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第182期計算期間(2020年10月21日～2020年11月20日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,140,224円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(188,784,745円)、分配準備積立金(176,090,981円)により、分配対象収益は366,015,950円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,357,824円(1万口当たり20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第183期計算期間(2020年11月21日～2020年12月21日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,835,015円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(188,471,069円)、分配準備積立金(173,321,903円)により、分配対象収益は364,627,987円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,349,814円(1万口当たり20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券は投資証券であります。

当ファンドの主な投資リスクとして、「金利変動リスク」、「信用リスク」、「期限前償還リスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」、「デリバティブ取引のリスク」等があります。

当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は、外貨建有価証券の売買の決済等に伴い必要となる外貨の売買の為に、その受渡日までの数日間の為替予約を利用しております。なお、当ファンドは外貨建資産の為替変動リスクの低減を目的としており、投機を目的とする為替予約は行わない方針であります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

ブラックロックソリューション・グリーンパッケージプロダクションチームが日次で計測し、運用部、その他の関係部署等にレポートをイントラネットで配信しております。また、運用ガイドラインのモニタリングはポートフォリオ・コンプライアンスチームが行っており、ガイドライン等を逸脱していた場合、関係部署へ報告され、適切な調整を行います。

(2) 信用リスクの管理

ファンダメンタル債券運用部により、国内債券の個別信用リスク及び銘柄間の相対価値については独自の定量・定性分析等を行っております。外国債券銘柄等については、社内のリサーチ・データベースによりグローバル・クレジット・チームとの情報・分析結果を共有しております。

(3) 取引先リスクの管理

リスク・クオンツ分析部は当社の親会社である米国のBlackRock, Inc.のRQA Counterparty & Concentration Riskチームと共に既存の承認済み取引先の信用悪化のモニタリングを行っており、取引先のデフォルトに対する取引先リスク、発行体リスクのファンドへの影響を分析しております。また、新規取引先の承認に際しては、リスク・クオンツ分析部が新規取引先申請の内容に問題がないかどうか確認を行い、当社の親会社である米国のBlackRock, Inc.のRQA Counterparty & Concentration Riskチームへ申請を行っております。

また、毎月開催される投資委員会では、リスク管理・運用分析手法等について審議を行っております。

金融商品の時価等に関する事項

前特定期間末 (2020年6月22日現在)	当特定期間末 (2020年12月21日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「（その他の注記）」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	前特定期間末 (2020年6月22日現在)	当特定期間末 (2020年12月21日現在)
期首元本額	1,827,046,911円	1,732,536,035円
期中追加設定元本額	9,363,653円	10,821,774円
期中一部解約元本額	103,874,529円	68,450,704円

2 有価証券関係

前特定期間末(2020年6月22日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	34,306,807
合計	34,306,807

当特定期間末(2020年12月21日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	14,215,942
合計	14,215,942

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

前特定期間末(2020年6月22日現在)

該当事項はありません。

区分	種類	当特定期間末（2020年12月21日現在）			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超 (円)		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	44,150,781	-	44,147,536	3,245
合計		44,150,781	-	44,147,536	3,245

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

1 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

特定期間末日において為替予約の受渡日(以下「当該日」という)の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

特定期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポ チュニティーズ・ファンド クラスJ 投資 証券	1,367,825.220	14,512,625.580	
		ブラックロック・グローバル・ファンズ USドル・ショート・デュレーション・ ボンド・ファンド クラスX 投資証券	10,034.470	161,354.270	
	アメリカドル 小計	1,377,859.690	14,673,979.850 (1,517,289,516)		
投資証券 合計				1,517,289,516 (1,517,289,516)	
合計				1,517,289,516 (1,517,289,516)	

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注2) 1 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しておりま
す。

3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資証券 2 銘柄	100.0%	100.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

当該事項はデリバティブ取引関係の注記事項として記載しております。

(参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ投資証券」及び「ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券」（以下、両者を併せて「同ファンド」という。）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された投資証券は、すべて同ファンドの投資証券であります。同ファンドの状況は以下のとおりであります。なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

同ファンドの状況

(1)同ファンドは、ルクセンブルグにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、同ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2020年2月29日に終了する中間計算期間(2019年9月1日から2020年2月29日まで)に係る中間財務書類であります。

(2)当該中間財務書類は、同ファンドを含む「ブラックロック・グローバル・ファンズ」の2020年2月29日現在の中間財務書類のうち、同ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、中間財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。なお、ルクセンブルグにおける独立監査人の監査を受けておりません。

純資産計算書 2020年2月29日現在（未監査）

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
資産			
投資有価証券 - 取得原価		8,883,942,299	1,907,236,178
未実現評価益		88,287,549	15,625,762
投資有価証券 - 時価	2 (a)	8,972,229,848	1,922,861,940
銀行預金	2 (a)	1,364,267,262	3,686,404
ブローカーに対する債権	15	51,006,567	3,783,547
未収利息および未収配当金	2 (a)	98,759,116	9,101,373
売却投資有価証券未収金	2 (a)	10,295,062,809*	131,910,963*
販売投資証券未収金	2 (a)	3,242,778	5,560,553
以下に係る未実現評価益：			
未決済上場先物取引	2 (c)	11,740,014	3,096,516
未決済先渡為替予約	2 (c)	1,712,941	2,911,955
事後通告証券契約の時価	2 (c)	138,998,373	69,594,831
スワップの時価	2 (c)	-	599,816
買建オプション/スワップオプションの時価	2 (c)	71,472,719	-
その他の資産	2 (a, c)	18,767	-
資産合計		21,008,511,194	2,153,107,898
負債			
銀行からの借入金	2 (a)	13,743	97,375
ブローカーに対する債務	15	34,748,594	3,514,777
未払収益分配金	2 (a)	1,058,842	121,909
購入投資有価証券未払金	2 (a)	10,318,032,814*	202,128,431*
買戻し投資証券未払金	2 (a)	5,199,305	2,358,953
以下に係る未実現評価損：			
差金決済契約	2 (c)	978,277	-
スワップの時価	2 (c)	6,491,230	-
売建オプション/スワップオプションの時価	2 (c)	81,906,876	-
その他の負債	5, 6, 7, 8	35,540,098	1,694,310
負債合計		10,483,969,779	209,915,755
純資産合計		10,524,541,415	1,943,192,143

* 事後通告証券契約を含む。詳細については、注記2を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末における純資産価額の概要 2020年2月29日現在(未監査)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

	通貨	2020年	2019年	2018年	2017年
		2月29日現在	8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
純資産合計	米ドル	10,524,541,415	9,742,532,405	11,829,873,767	9,265,244,959
以下の1口当たり純資産価額:					
クラスA 毎年分配型投資証券	米ドル	10.19	9.97	9.78	9.94
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.46	9.38	9.50	9.91
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	10.24	10.14	9.95	10.11
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	10.23	10.13	9.94	10.10
クラスA 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.26	10.18	9.98	10.15
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	6.89	6.93	7.00	7.31
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	シンガポール・ドル	14.69	14.60	14.43	14.80
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	豪ドル	9.31	9.31	9.29	9.61
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア中国人民元	96.47	95.96	95.75	99.07
クラスA 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	12.20	12.19	12.06	12.40
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	香港ドル	92.06	91.92	91.83	95.54
クラスA 無分配投資証券	米ドル	14.92	14.61	13.95	13.86
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.05	9.99	9.88	10.12
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.07	9.98	9.83	10.03
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,057	1,047	1,030	1,047
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ズロチ	16.14	15.84	15.29	15.32
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	102.56	101.54	99.93	102.02
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	21.39	20.99	20.21	20.25
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.61	10.47	10.19	10.29
クラスA I 無分配投資証券	米ドル	11.85	11.60	-	-
クラスA I ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.26	10.18	-	-
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	10.24	10.14	9.95	10.11
クラスC 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.21	10.12	9.92	10.09
クラスC 無分配投資証券	米ドル	12.69	12.50	12.09	12.16
クラスD 毎年分配型投資証券	米ドル	13.83	13.50	13.24	13.46
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	カナダ・ドル	10.02	9.81	9.71	9.94
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.48	9.38	9.50	9.91

3 会計年度末における純資産価額の概要 2020年2月29日現在(未監査)(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(続き)

	通貨	2020年 2月29日現在	2019年 8月31日現在	2018年 8月31日現在	2017年 8月31日現在
クラスD英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	4.80	4.72	4.72	4.88
クラスD 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.79	10.70	10.49	10.67
クラスD スイス・フラン・ヘッジ 毎四半期分配型投資証券	スイス・フラン	9.38	9.45	9.59	-
クラスD ユーロ・ヘッジ 毎四半期分配型投資証券	ユーロ	6.91	6.95	7.02	7.33
クラスD 無分配投資証券	米ドル	15.46	15.10	14.35	14.18
クラスD スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	スイス・フラン	10.81	10.72	10.55	10.75
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	10.70	10.58	10.37	10.53
クラスD 英ポンド・ヘッジ 無分配投資証券	英ポンド	11.51	11.32	10.96	11.02
クラスD ポーランド・ズロチ・ヘッジ 無分配投資証券	ポーランド・ズロチ	16.75	16.39	15.75	15.70
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	シンガポール・ドル	22.19	21.72	20.81	20.74
クラスE 無分配投資証券	米ドル	13.94	13.68	13.13	13.11
クラスE ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	9.44	9.38	9.29	9.52
クラスI カナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	9.78	9.70	9.61	9.83
クラスI 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.05	9.96	9.77	9.94
クラスI ユーロ・ヘッジ 毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.16	9.21	9.31	9.72
クラスI 英ポンド・ヘッジ 毎四半期分配型投資証券	英ポンド	10.11	10.10	-	-
クラスI 日本円ヘッジ 毎四半期分配型投資証券	日本円	967	971	981	-
クラスI 無分配投資証券	米ドル	12.31	12.01	11.39	11.25
クラスI 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	10.58	10.38	9.93	-
クラスI カナダ・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	カナダ・ドル	11.47	11.21	10.73	10.66
クラスI スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	スイス・フラン	11.54	11.42	11.23	11.42
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	11.03	10.90	10.67	10.81
クラスI 英ポンド・ヘッジ 無分配投資証券	英ポンド	11.61	11.41	11.03	11.08
クラスI 日本円ヘッジ 無分配投資証券	日本円	1,101	1,087	1,063	1,073
クラスJ 毎月分配型投資証券	米ドル	10.24	10.14	9.95	10.11
クラスS ユーロ・ヘッジ 毎年分配型投資証券	ユーロ	10.21	10.10	-	-
クラスS 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.34	10.25	-	-

3 会計年度末における純資産価額の概要 2020年2月29日現在(未監査)(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(続き)

	通貨	2020年 2月29日現在	2019年 8月31日現在	2018年 8月31日現在	2017年 8月31日現在
クラスS無分配投資証券	米ドル	10.51	10.26	-	-
クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.27	10.18	-	-
クラスSユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.31	10.19	-	-
クラスX毎月分配型投資証券	米ドル	10.24	10.14	9.95	10.11
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	豪ドル	10.66	10.61	10.49	10.67
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	ユーロ	9.24	9.27	9.38	9.78
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.48	9.52	9.63	-
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	英ポンド	9.57	9.56	9.55	9.88
クラスX無分配投資証券	米ドル	11.99	11.67	11.02	10.82
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	12.47	12.20	11.61	11.41
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	11.54	11.25	10.72	10.60
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.93	11.79	11.52	11.66
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	11.64	11.48	11.17	11.26
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.44	11.21	10.79	10.78
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	10.84	10.67	10.38	10.48

ヘッジおよび英国報告型の投資証券クラスを除き、各投資証券クラスの価格はファンドの基準通貨で設定される。2種類以上の取引通貨が入手可能な当該投資証券クラスの場合、追加の取引通貨額は評価時点の関連する直物為替レートで当該額を換算することによって算定される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末における純資産価額の概要 2020年2月29日現在(未監査)(続き)

USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

	通貨	2020 2月29日現在	2019 8月31日現在	2018年 8月31日現在	2017年 8月31日現在
純資産合計	米ドル	1,943,192,143	1,756,701,574	1,968,227,941	1,693,798,830
以下の1口当たり純資産価額:					
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	8.58	8.56	8.41*	8.57
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	8.58	8.55	8.40*	8.56
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	シンガポール・ドル	9.66	9.65	9.56*	9.82
クラスA 無分配投資証券	米ドル	13.92	13.74	13.19*	13.18
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.02	10.03	9.92*	10.18
クラスA I 無分配投資証券	米ドル	10.34	10.21	-	-
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	8.59	8.57	8.42*	8.58
クラスC 無分配投資証券	米ドル	11.21	11.14	10.82*	10.95
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	9.85	9.82	9.64*	9.83
クラスD 無分配投資証券	米ドル	14.28	14.07	13.45*	13.40
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.97	9.96	9.82*	10.04
クラスE 無分配投資証券	米ドル	12.67	12.54	12.09*	12.15
クラスI 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.27	10.25	-	-
クラスI 無分配投資証券	米ドル	10.88	10.72	10.24*	10.19
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.02	10.00	9.85*	10.06
クラスX 無分配投資証券	米ドル	15.63	15.37	14.63*	14.50

ヘッジおよび英国報告型の投資証券クラスを除き、各投資証券クラスの価格はファンドの基準通貨で設定される。2種類以上の取引通貨が入手可能な当該投資証券クラスの場合、追加の取引通貨額は評価時点の関連する直物為替レートで当該額を換算することによって算定される。

* 希薄化調整を含む。詳細については、注記2(g)を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2019年9月1日から2020年2月29日までの期間(未監査)

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
期首純資産		9,742,532,405	1,756,701,574
収益			
預金利息	2 (b)	6,224,231	364,584
債券利息、源泉徴収税控除後	2 (b)	174,869,164	25,160,346
スワップ利息	2 (c)	45,743,761	947,061
短期金融商品預け入れによる利息	2 (b)	7,159	252,202
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	2 (b)	124,114	-
配当金、源泉徴収税控除後	2 (b)	1,433,560	-
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	32,282	-
有価証券貸付による収益	2 (b)	441,913	16,105
収益合計	2 (b)	228,876,184	26,740,298
費用			
スワップ利息	2 (c)	52,447,836	1,353,640
差金決済契約に係る配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	75,319	-
管理事務代行報酬	7	3,591,246	521,594
保管および預託報酬	2 (h), 8	1,007,303	126,306
販売報酬	6	2,238,323	435,340
税金	9	1,147,251	302,746
投資運用報酬	5	20,185,937	3,936,624
費用合計		80,693,215	6,676,250
純利益		148,182,969	20,064,048
以下に係る実現純評価益/(損) :			
投資有価証券	2 (a)	125,450,313	2,325,718
事後通告証券契約	2 (c)	30,332,181	646,953
差金決済取引	2 (c)	1,768,733	-
上場先物取引	2 (c)	(33,230,087)	(6,307,810)
オプション/スワップション契約	2 (c)	64,532,470	-
スワップ取引	2 (c)	(48,737,771)	1,937,416
先渡為替予約	2 (c)	(43,911,017)	(8,002,040)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	7,377,653	310,181
当期実現純評価益/(損)		103,582,475	(9,089,582)
以下に係る未実現評価益/(損)の純変動額 :			
投資有価証券	2 (a)	(59,978,652)	4,881,426
事後通告証券契約	2 (c)	102,746	380,230
差金決済取引	2 (c)	(1,135,141)	-
上場先物取引	2 (c)	18,982,420	3,675,979
オプション/スワップション契約	2 (c)	(8,361,204)	-
スワップ取引	2 (c)	23,958,663	(2,680,794)
先渡為替予約	2 (c)	6,359,686	4,535,866
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(2,339,763)	(61,941)
当期末実現評価益/(損)の純変動		(22,411,245)	10,730,766
運用成績による純資産の増加		229,354,199	21,705,232

損益および純資産変動計算書 2019年9月1日から2020年2月29日までの期間(未監査)(続き)

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		1,652,749,608	576,291,061
投資証券買戻しによる正味支払額		(1,080,205,488)	(410,224,524)
資本の変動による純資産の減少		572,544,120	166,066,537
配当金宣言額	16	(19,889,309)	(1,281,200)
期末純資産		10,524,541,415	1,943,192,143

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2019年9月1日から2020年2月29日までの期間（未監査）

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・
ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎年分配型投資証券	77,294	7,053	1,187	83,160
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,042,610	36,532	120,808	958,334
クラスA 毎日分配型投資証券	3,992,272	712,517	330,965	4,373,824
クラスA 毎月分配型投資証券	423,306	338,475	49,940	711,841
クラスA 毎四半期分配型投資証券	6,753,471	509,591	1,059,604	6,203,458
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,053,044	171,285	164,920	1,059,409
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	235,806	153,978	91,408	298,376
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	154,140	81,864	2,836	233,168
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	47,320	-	-	47,320
クラスA 安定毎月総収益分配型投資証券	194,957	23,088	5,250	212,795
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	63,861	-	-	63,861
クラスA 無分配投資証券	47,692,095	6,778,132	5,994,612	48,475,615
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	4,243,471	239,720	712,981	3,770,210
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	13,957,628	1,733,198	3,850,264	11,840,562
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	566	-	-	566
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	9,466,147	2,941,046	3,377,530	9,029,663
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	683,402	7,086	171,112	519,376
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	5,351,217	813,882	348,442	5,816,657
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	317,825	17,678	49,109	286,394
クラスA I 無分配投資証券	445	5,713	-	6,158
クラスA I ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	445	7,277	-	7,722
クラスC 毎日分配型投資証券	421,303	52,672	50,379	423,596
クラスC 毎四半期分配型投資証券	852,353	14,890	85,418	781,825
クラスC 無分配投資証券	7,022,337	820,630	1,032,022	6,810,945
クラスD 毎年分配型投資証券	121,497	-	32,591	88,906
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,102,303	59,732	49,307	1,112,728
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	508,344	114,154	109,008	513,490
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	3,116,868	434,207	367,424	3,183,651
クラスD 毎四半期分配型投資証券	15,601,415	3,194,144	1,473,675	17,321,884
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	879,539	682,825	37,569	1,524,795
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,423,143	143,354	59,846	1,506,651
クラスD 無分配投資証券	44,769,426	10,442,837	7,566,693	47,645,570
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	5,748,769	250,914	1,124,367	4,875,316

発行済投資証券口数変動表 2019年9月1日から2020年2月29日までの期間(未監査)(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・
ファンド(続き)

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	32,961,179	3,319,635	7,285,566	28,995,248
クラスD英債券・ヘッジ無分配投資証券	3,889,882	820,317	1,089,533	3,620,666
クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	41,037	-	-	41,037
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	22,840	-	-	22,840
クラスE無分配投資証券	17,120,677	1,143,055	2,574,047	15,689,685
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	45,431,212	1,695,205	10,220,464	36,905,953
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	44,930	-	-	44,930
クラスI毎四半期分配型投資証券	13,534,206	11,480,024	5,295,908	19,718,322
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	3,548,771	224,253	12,790	3,760,234
クラスI英債券・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,620,942	355,691	21,875	1,954,758
クラスI日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	21,332	13,005	1,135	33,202
クラスI無分配投資証券	81,716,644	20,131,492	10,628,915	91,219,221
クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	15,363	6,997	4,553	17,807
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	14,158,928	1,070,712	497,610	14,732,030
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	5,288,431	88,443	3,755,199	1,621,675
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	48,628,912	5,719,980	9,499,355	44,849,537
クラスI英債券・ヘッジ無分配投資証券	35,567,544	228,126	3,127,323	32,668,347
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	42,610,921	1,891,572	2,756,695	41,745,798
クラスJ毎月分配型投資証券	1,646,094	83,951	244,543	1,485,502
クラスSユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	63,486	36,150	12,351	87,285
クラスS毎四半期分配型投資証券	151,575	123,626	7,309	267,892
クラスS無分配投資証券	424,919	397,080	1,589	820,410
クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	1,680,298	568,669	166,438	2,082,529
クラスSユーロ・ヘッジ無分配投資証券	325,910	235,504	21,998	539,416
クラスX毎月分配型投資証券	35,926,051	25,595	136,880	35,814,766
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,345,016	276,368	74,365	1,547,019
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	336,730	6,452	14,882	328,300
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	7,657,859	2,653,937	-	10,311,796
クラスX英債券・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	12,779,254	3,558,262	9,891	16,327,625
クラスX無分配投資証券	79,509,027	48,636,362	61,956	128,083,433
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	8,346,030	140,938	208,870	8,278,098
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	117,033,313	2,062,065	4,831,850	114,263,528
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	3,849,144	805,768	-	4,654,912
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	6,035,847	240,686	197,806	6,078,727
クラスX英債券・ヘッジ無分配投資証券	45,524,592	-	1,373,625	44,150,967
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	108,022,672	11,140,120	4,647,709	114,515,083

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2019年9月1日から2020年2月29日までの期間(未監査)(続き)

U S 달러・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎日分配型投資証券	3,330,677	555,950	674,851	3,211,776
クラスA 毎月分配型投資証券	1,286,263	1,158,837	952,754	1,492,346
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	57,625	3,328	5,349	55,604
クラスA 無分配投資証券	34,454,083	8,301,060	7,499,901	35,255,242
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	2,222,009	510,203	250,072	2,482,140
クラスA I 無分配投資証券	1,000	-	-	1,000
クラスC 毎日分配型投資証券	267,527	270	38,793	229,004
クラスC 無分配投資証券	844,743	2,145,325	759,708	2,230,360
クラスD 毎月分配型投資証券	4,012,094	750,056	620,959	4,141,191
クラスD 無分配投資証券	22,225,680	4,125,196	3,451,074	22,899,802
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	287,968	189,112	129,533	347,547
クラスE 無分配投資証券	10,630,759	1,270,635	2,627,622	9,273,772
クラスI 毎四半期分配型投資証券	2,949,440	38,480	-	2,987,920
クラスI 無分配投資証券	2,136,243	4,644,779	210,019	6,571,003
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	12,098,697	25,472,581	9,993,529	27,577,749
クラスX 無分配投資証券	34,588,865	200,339	5,149,616	29,639,588

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

投資有価証券明細表 2020年2月29日現在(未監査)

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ファンド			
米国			
164,300	SPDR S&P 500 ETF Trust	47,254,323	0.45
ファンド合計		47,254,323	0.45
普通/優先株式およびワラント			
ブラジル			
296,599	JBS SA	1,416,569	0.02
281,448	Oi SA ADR	287,077	0.00
		1,703,646	0.02
カナダ			
350,962	Largo Resources Ltd*	227,141	0.00
70,550	Lions Gate Entertainment Corp*	541,118	0.01
5,883	Norbord Inc	157,253	0.00
99,749	Northern Graphite Corp (Unit)	11,501	0.00
		937,013	0.01
ケイマン諸島			
32,048	21Vianet Group Inc ADR	459,568	0.00
147,094	Vantage Drilling Co	674	0.00
1,826,000	WH Group Ltd	1,855,463	0.02
		2,315,705	0.02
フランス			
54,000	BNP Paribas SA	2,562,713	0.03
204,000	Credit Agricole SA	2,389,576	0.02
63,000	Renault SA	1,798,944	0.02
30,000	TOTAL SA	1,249,342	0.01
		8,000,575	0.08
ドイツ			
35,000	Bayerische Motoren Werke AG	2,221,088	0.02
54,000	Daimler AG	2,186,924	0.02
		4,408,012	0.04
香港			
32,024	China Mobile Ltd ADR*	1,244,453	0.01
イタリア			
76	EneI SpA	629	0.00
272,389	Snam SpA	1,335,714	0.01
560,285	Telecom Italia SpA/Milano	309,836	0.00
553,801	UniCredit SpA	6,917,045	0.07
		8,563,224	0.08
オランダ			
176,000	ABN AMRO Bank NV	2,411,950	0.02
26,803	Altice Europe NV	140,429	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
384,700	ING Groep NV	3,592,322	0.04
37,050	NXP Semiconductors NV	4,143,672	0.04
		10,288,373	0.10
スペイン			
27,329	Banco Santander SA (Pref)	653,163	0.01
216,399	Telefonica SA	1,270,729	0.01
		1,923,892	0.02
英国			
51,219	Arrow Global Group Plc*	154,869	0.00
1,946,418	New Look	37,438	0.00
102,000	Royal Dutch Shell Plc	2,171,427	0.02
		2,363,734	0.02
米国			
6,260	Acadia Healthcare Co Inc	185,296	0.00
24,171	Advanced Micro Devices Inc	1,016,391	0.01
1,168	Alphabet Inc 'A'	1,493,860	0.01
154,288	Altice USA Inc*	3,888,058	0.04
3,221	Amazon.com Inc	5,876,908	0.06
5,560	Amgen Inc	1,096,488	0.01
6,587	Analog Devices Inc	694,533	0.01
6,443	Apple Inc	1,677,822	0.02
73,294	Applied Materials Inc	4,050,959	0.04
271,129	Bank of America Corp	7,553,654	0.07
31,427	Beazer Homes USA Inc	386,552	0.00
2,595	Broadcom Inc	689,050	0.01
41,858	Century Communities Inc*	1,355,362	0.01
12,891	Cisco Systems Inc	497,335	0.01
143,800	Citigroup Inc	8,883,964	0.08
29,456	Corning Inc	679,697	0.01
110,676	Delta Air Lines Inc	5,189,598	0.05
25,983	Diamondback Energy Inc*	1,518,966	0.01
127,641	DR Horton Inc	6,803,265	0.06
269,383	Eldorado Resorts Inc*	12,887,283	0.12
14,078	Everi Holdings Inc	148,101	0.00
87,600	Federal Home Loan Mortgage Corp (Pref)	887,914	0.01
87,600	Federal National Mortgage Association (Pref)	902,280	0.01
31,102	Forestar Group Inc*	550,505	0.01
29,911	Gaming and Leisure Properties Inc (Reit)	1,276,003	0.01
33,079	HCA Healthcare Inc	4,132,559	0.04
7,242	Johnson & Johnson	959,637	0.01
57,100	JPMorgan Chase & Co	6,598,476	0.06
190,000	Kinder Morgan Inc/DE	3,566,300	0.03
15,936	Lam Research Corp*	4,443,435	0.04
58,107	M/I Homes Inc	2,179,012	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
49,373	MGM Growth Properties LLC (Reit) 'A'*	1,369,607	0.01
15,682	Microchip Technology Inc*	1,374,057	0.01
8,690	Microsoft Corp	1,345,386	0.01
9,079	Morgan Stanley	398,931	0.00
8,248	Morgan Stanley (Pref)*	231,769	0.00
19,561	NVIDIA Corp	4,847,216	0.05
144,238	PulteGroup Inc	5,781,059	0.06
37,140	Rattler Midstream LP	450,880	0.00
141,655	Simply Good Foods Co/The	3,010,169	0.03
160,601	Target Hospitality Corp*	732,341	0.01
6,913	Target Hospitality Corp (Wts 15/3/2024)	4,355	0.00
186,763	Taylor Morrison Home Corp 'A'*	4,192,829	0.04
68	Tesla Inc	42,514	0.00
39,556	Texas Instruments Inc	4,421,570	0.04
11,108	Tyson Foods Inc 'A'	739,015	0.01
144,000	Verizon Communications Inc	7,581,600	0.07
91,273	Vistra Energy Corp	1,780,736	0.02
10,951	Walt Disney Co/The	1,250,057	0.01
170,000	Williams Cos Inc/The	3,187,500	0.03
33,664	Wynn Resorts Ltd	3,676,109	0.04
60,794	Xilinx Inc	4,809,413	0.05
		143,296,376	1.36
普通/優先株式およびワラント合計		185,045,003	1.76
	コマーシャル・ペーパー		
	米国		
USD	8,260,000 Boeing Co/The 7/4/2020 (Zero Coupon)	8,243,526	0.08
	コマーシャル・ペーパー合計	8,243,526	0.08
	債券		
	アンゴラ		
USD	1,992,000 Angolan Government International Bond 8.25% 9/5/2028	2,060,164	0.02
	アルゼンチン		
USD	539,875 Aeropuertos Argentina 2000 SA '144A' 6.875% 1/2/2027	508,326	0.00
USD	150,000 AES Argentina Generacion SA '144A' 7.75% 2/2/2024	125,738	0.00
USD	774,000 Arcor SAIC '144A' 6% 6/7/2023	747,273	0.01
USD	16,154,000 Argentine Republic Government International Bond 5.875% 11/1/2028	6,693,814	0.06
USD	5,166,000 Argentine Republic Government International Bond 6.875% 22/4/2021*	2,623,359	0.03
USD	7,257,000 Argentine Republic Government International Bond 6.875% 11/1/2048*	2,943,621	0.03
USD	4,409,000 Argentine Republic Government International Bond 7.125% 6/7/2036	1,826,290	0.02
USD	6,472,000 Generacion Mediterraneo SA / Generacion Frias SA / Central Termica Roca SA '144A' 9.625% 27/7/2023	4,206,800	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アルゼンチン(続き)			
USD	511,000 Genneia SA '144A' 8.75% 20/1/2022	430,358	0.00
USD	362,000 Pampa Energia SA '144A' 7.375% 21/7/2023	319,861	0.00
USD	194,000 Pampa Energia SA '144A' 9.125% 15/4/2029	169,750	0.00
USD	651,000 Telecom Argentina SA '144A' 6.5% 15/6/2021	637,980	0.01
USD	226,000 Telecom Argentina SA '144A' 8% 18/7/2026	211,310	0.00
USD	150,000 Transportadora de Gas del Sur SA '144A' 6.75% 2/5/2025	134,738	0.00
USD	2,426,000 YPF SA 7% 15/12/2047*	1,795,240	0.02
USD	683,000 YPF SA 8.5% 28/7/2025	582,364	0.01
USD	343,000 YPF SA '144A' 8.75% 4/4/2024	312,987	0.00
		24,269,809	0.23
オーストラリア			
AUD	18,875,000 Australia Government Bond 3% 21/3/2047	16,693,503	0.16
USD	1,450,000 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd 5.95% 15/10/2039	1,957,259	0.02
USD	204,000 FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.5% 15/9/2027	199,787	0.00
USD	1,158,000 FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.75% 15/5/2022	1,179,602	0.01
USD	778,000 FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.125% 15/3/2023	807,105	0.01
USD	1,163,000 FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.125% 15/5/2024*	1,213,003	0.01
USD	187,500 Linc Energy Ltd (Defaulted) 10/4/2018 (Zero Coupon)	5,625	0.00
USD	3,640,000 Pacific National Finance Pty Ltd 4.75% 22/3/2028	4,065,571	0.04
USD	777,000 QBE Insurance Group Ltd FRN 17/6/2046*	858,243	0.01
USD	4,100,000 Santos Finance Ltd 5.25% 13/3/2029	4,599,646	0.04
GBP	4,010,000 Westfield America Management Ltd 2.125% 30/3/2025	5,325,439	0.05
		36,904,783	0.35
オーストリア			
EUR	1,200,000 BAWAG Group AG FRN 14/5/2025 (Perpetual)	1,398,973	0.01
EUR	4,400,000 BAWAG Group AG FRN 26/3/2029	4,979,534	0.05
EUR	3,400,000 BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 0.375% 3/9/2027	3,592,959	0.03
USD	475,000 BRF GmbH 4.35% 29/9/2026	483,164	0.00
USD	3,251,000 BRF GmbH '144A' 4.35% 29/9/2026	3,306,877	0.03
EUR	4,000,000 Erste Group Bank AG FRN 15/10/2021 (Perpetual)	4,891,638	0.05
EUR	4,800,000 Erste Group Bank AG FRN 15/4/2024 (Perpetual)	5,968,675	0.06
USD	665,000 JBS Investments II GmbH '144A' 5.75% 15/1/2028	702,007	0.01
USD	1,558,000 JBS Investments II GmbH '144A' 7% 15/1/2026	1,677,218	0.02
USD	2,384,000 Suzano Austria GmbH 5% 15/1/2030*	2,495,750	0.02
USD	472,000 Suzano Austria GmbH 5.75% 14/7/2026	536,900	0.01
		30,033,695	0.29
バハマ			
USD	1,486,000 Intercorp Peru Ltd '144A' 3.875% 15/8/2029*	1,543,582	0.01
バハマ, The			
USD	1,782,000 Silversea Cruise Finance Ltd '144A' 7.25% 1/2/2025	1,867,385	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		パーレーン		
USD	1,188,000	CBB International Sukuk Co 7 SPC 6.875% 5/10/2025	1,382,535	0.01
		ベルギー		
GBP	3,585,000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.75% 7/3/2025	4,707,650	0.04
EUR	630,000	House of Finance NV/The 4.375% 15/7/2026*	685,789	0.01
EUR	1,200,000	KBC Group NV FRN 24/10/2025 (Perpetual)*	1,353,975	0.01
			6,747,414	0.06
		バミューダ		
USD	692,885	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd 6% 19/12/2022	588,952	0.01
USD	4,242,483	Digicel Group Two Ltd ' 144A ' 8.25% 30/9/2022	1,099,068	0.01
USD	8,777	Digicel Group Two Ltd 9.125% 1/4/2024*	1,498	0.00
USD	2,863,000	Digicel Ltd ' 144A ' 6% 15/4/2021*	2,287,269	0.02
USD	369,000	Digicel Ltd ' 144A ' 6.75% 1/3/2023	238,697	0.00
USD	200,000	Geopark Ltd ' 144A ' 5.5% 17/1/2027	194,400	0.00
USD	779,000	Geopark Ltd ' 144A ' 6.5% 21/9/2024	790,807	0.01
USD	300,000	Hopson Development Holdings Ltd 7.5% 27/6/2022	303,000	0.00
USD	2,041,000	Inkia Energy Ltd ' 144A ' 5.875% 9/11/2027	2,158,676	0.02
USD	4,600,000	Luye Pharma Group Ltd 1.5% 9/7/2024	4,703,155	0.05
USD	501,000	NCL Corp Ltd ' 144A ' 3.625% 15/12/2024	475,950	0.01
HKD	4,062,966	REXLot Holdings Ltd (Restricted) (Defaulted) 4.5% 17/4/2019	443,086	0.00
HKD	348,254	REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 6% 28/4/2017	14,895	0.00
			13,299,453	0.13
		ブラジル		
USD	4,842,000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands ' 144A ' 3.2% 27/1/2025	4,851,079	0.05
USD	3,138,000	Banco Votorantim SA ' 144A ' 4% 24/9/2022	3,224,785	0.03
USD	2,951,000	Banco Votorantim SA ' 144A ' 4.5% 24/9/2024	3,110,999	0.03
USD	4,256,000	Brazilian Government International Bond 4.625% 13/1/2028	4,706,115	0.04
USD	570,000	Brazilian Government International Bond 4.875% 22/1/2021	586,477	0.01
USD	1,578,000	Brazilian Government International Bond 5.625% 21/2/2047*	1,897,298	0.02
USD	4,910,000	Centrais Eletricas Brasileiras SA ' 144A ' 3.625% 4/2/2025	4,881,866	0.05
USD	2,238,000	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island ' 144A ' FRN 12/12/2022 (Perpetual)	2,296,845	0.02
USD	1,554,000	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island ' 144A ' FRN 19/3/2023 (Perpetual)	1,617,617	0.01
USD	5,233,000	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island ' 144A ' 2.9% 24/1/2023	5,210,106	0.05
USD	5,722,000	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island ' 144A ' 3.25% 24/1/2025	5,691,673	0.05
USD	6,749,000	Oi SA 10% 27/7/2025	6,602,420	0.06
			44,677,280	0.42
		英領バージン諸島		
EUR	2,500,000	ANLLIAN Capital Ltd 5/2/2025 (Zero Coupon)	2,634,328	0.03
USD	748,000	Baoxin Auto Finance I Ltd FRN 30/10/2020 (Perpetual)	546,005	0.01
USD	2,435,000	Beijing Environment Bvi Co Ltd 5.3% 18/10/2021	2,519,844	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英領バージン諸島(続き)		
USD	1,315,000 Bi Hai Co Ltd 6.25% 5/3/2022	1,377,668	0.01
USD	5,395,000 CCTI 2017 Ltd 3.625% 8/8/2022	5,459,066	0.05
USD	946,000 Central American Bottling Corp ' 144A ' 5.75% 31/1/2027	1,000,543	0.01
HKD	15,000,000 China Conch Venture Holdings International Ltd 5/9/2023 (Zero Coupon)	2,136,194	0.02
USD	6,405,000 China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd 3% 10/12/2029	6,761,278	0.06
USD	4,176,000 China Reinsurance Finance Corp Ltd 3.375% 9/3/2022	4,252,995	0.04
USD	1,830,000 Chinalco Capital Holdings Ltd FRN 11/9/2024 (Perpetual)*	1,884,614	0.02
USD	3,450,000 Chinalco Capital Holdings Ltd 4.25% 21/4/2022	3,505,890	0.03
USD	3,015,000 Coastal Emerald Ltd FRN 1/8/2024 (Perpetual)*	3,059,754	0.03
USD	1,740,000 Coastal Emerald Ltd 3.95% 1/8/2022	1,753,050	0.02
USD	1,591,000 Easy Tactic Ltd 8.125% 11/7/2024	1,545,123	0.02
USD	1,800,000 Easy Tactic Ltd 8.625% 27/2/2024*	1,788,237	0.02
USD	200,000 Easy Tactic Ltd 9.125% 28/7/2022	206,500	0.00
USD	200,000 ENN Clean Energy International Investment Ltd 7.5% 27/2/2021	205,500	0.00
USD	2,460,000 Franshion Brilliant Ltd 4.25% 23/7/2029	2,619,900	0.03
USD	859,000 Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd ' 144A ' 5.125% 15/5/2024	939,934	0.01
USD	200,000 Greenland Global Investment Ltd 7.25% 12/3/2022	202,250	0.00
USD	1,735,000 Guojing Capital BVI Ltd 3.95% 11/12/2022	1,771,327	0.02
USD	2,400,000 Hopson Capital International Group Co Ltd 6% 17/2/2021	2,397,000	0.02
USD	5,600,000 Huarong Finance 2019 Co Ltd 3.25% 13/11/2024	5,760,544	0.06
USD	3,700,000 Huarong Finance 2019 Co Ltd 3.375% 24/2/2030*	3,696,848	0.04
USD	4,000,000 Huarong Finance 2019 Co Ltd 3.875% 13/11/2029*	4,147,560	0.04
USD	4,600,000 Huarong Finance 2019 Co Ltd 4.5% 29/5/2029*	5,001,062	0.05
USD	3,875,000 Joy Treasure Assets Holdings Inc 3.5% 24/9/2029*	4,105,684	0.04
USD	1,270,000 Joy Treasure Assets Holdings Inc 4.5% 20/3/2029*	1,444,427	0.01
USD	1,853,000 Knight Castle Investments Ltd 7.99% 23/1/2021	995,987	0.01
USD	2,500,000 Leader Goal International Ltd FRN 19/1/2023 (Perpetual)	2,560,860	0.03
USD	1,545,000 New Lion Bridge Co Ltd 9.75% 10/10/2020	1,362,072	0.01
USD	1,448,000 New Metro Global Ltd 6.5% 23/4/2021	1,457,007	0.01
USD	3,200,000 NWD MTN Ltd 4.125% 18/7/2029	3,355,000	0.03
USD	2,418,000 Prime Bloom Holdings Ltd 6.95% 5/7/2022	1,185,521	0.01
USD	300,000 RKP Overseas 2019 A Ltd 7.875% 1/2/2023	318,000	0.00
USD	1,959,000 Rock International Investment Inc 6.625% 27/3/2020	930,525	0.01
USD	5,365,000 Rongshi International Finance Ltd 3.75% 21/5/2029	5,983,652	0.06
USD	3,702,000 Scenery Journey Ltd 11% 6/11/2020	3,771,412	0.04
USD	1,390,000 Scenery Journey Ltd 11.5% 24/10/2022	1,363,937	0.01
USD	200,000 Scenery Journey Ltd 13% 6/11/2022	203,437	0.00
USD	263,000 Shanghai Port Group BVI Holding Co Ltd 9/8/2022 (Zero Coupon)	269,657	0.00
USD	2,125,000 Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd 4.75% 5/8/2029	2,180,449	0.02
USD	1,370,000 Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd 5.25% 30/4/2022	1,435,301	0.01
USD	184,000 Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd ' 144A ' 6.75% 24/4/2033	196,873	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英領バージン諸島(続き)			
USD	200,000 Studio City Finance Ltd 7.25% 11/2/2024	207,000	0.00
		100,499,815	0.96
カナダ			
USD	255,000 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc ' 144A ' 3.875% 15/1/2028	256,109	0.00
USD	520,000 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc ' 144A ' 4.25% 15/5/2024	525,348	0.00
USD	2,935,725 Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust ' 144A ' 5% 15/12/2023	3,092,496	0.03
GBP	2,060,000 Bank of Nova Scotia/The 1.375% 5/12/2023	2,657,546	0.02
EUR	2,506,000 Bausch Health Cos Inc 4.5% 15/5/2023	2,756,116	0.03
USD	5,073,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 5.5% 1/11/2025	5,246,928	0.05
USD	546,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 5.75% 15/8/2027	582,527	0.00
USD	68,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 5.875% 15/5/2023	68,230	0.00
USD	1,344,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 6.125% 15/4/2025	1,387,122	0.01
USD	7,107,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 7% 15/3/2024	7,379,447	0.07
USD	313,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 7% 15/1/2028	339,793	0.00
USD	622,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 7.25% 30/5/2029	686,906	0.01
USD	619,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 9% 15/12/2025	691,547	0.01
USD	3,838,000 Bombardier Inc ' 144A ' 8.75% 1/12/2021	4,165,189	0.04
USD	5,632,000 Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US Corp ' 144A ' 6.25% 15/9/2027	5,853,619	0.06
USD	634,000 First Quantum Minerals Ltd ' 144A ' 7.25% 1/4/2023	614,219	0.01
USD	572,000 Masonite International Corp ' 144A ' 5.375% 1/2/2028	605,948	0.01
USD	110,000 Masonite International Corp ' 144A ' 5.75% 15/9/2026	116,496	0.00
USD	2,200,000 Mattamy Group Corp ' 144A ' 4.625% 1/3/2030	2,170,905	0.02
USD	2,205,000 Mattamy Group Corp ' 144A ' 5.25% 15/12/2027	2,307,532	0.02
USD	1,616,000 Mattamy Group Corp (Restricted) ' 144A ' 6.5% 1/10/2025	1,738,469	0.02
USD	4,250,000 NOVA Chemicals Corp ' 144A ' 4.875% 1/6/2024	4,152,611	0.04
USD	6,147,000 NOVA Chemicals Corp ' 144A ' 5.25% 1/8/2023	6,177,674	0.06
EUR	5,110,000 Royal Bank of Canada 0.125% 23/7/2024	5,619,405	0.05
GBP	705,000 Royal Bank of Canada 1.125% 15/12/2025	893,896	0.01
USD	863,000 Seven Generations Energy Ltd ' 144A ' 5.375% 30/9/2025	785,339	0.01
USD	6,638,330 Stoneway Capital Corp ' 144A ' 10% 1/3/2027	3,120,015	0.03
USD	2,804,641 Stoneway Capital Corp 10% 1/3/2027*	1,310,732	0.01
USD	925,000 Telesat Canada / Telesat LLC ' 144A ' 6.5% 15/10/2027	968,688	0.01
		66,270,852	0.63
ケイマン諸島			
USD	1,565,000 21Vianet Group Inc 7.875% 15/10/2021*	1,573,542	0.02
USD	793,000 Agile Group Holdings Ltd FRN 7/3/2023 (Perpetual)	804,069	0.01
USD	3,461,111 Ambac LSNI LLC ' 144A ' FRN 12/2/2023	3,521,657	0.03
USD	1,624,000 Anton Oilfield Services Group/ Hong Kong 9.75% 5/12/2020*	1,657,495	0.02
USD	773,000 Baozun Inc ' 144A ' 1.625% 1/5/2024	725,452	0.01
USD	230,000 Bioceanico Sovereign Certificate Ltd 5/6/2034 (Zero Coupon)	167,361	0.00
USD	200,000 Bright Scholar Education Holdings Ltd 7.45% 31/7/2022	207,750	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD	515,000 Central China Real Estate Ltd 6.5% 5/3/2021	513,076	0.00
USD	1,055,000 Central China Real Estate Ltd 6.75% 8/11/2021	1,050,827	0.01
USD	1,605,000 Central China Real Estate Ltd 6.875% 23/10/2020	1,609,013	0.02
USD	200,000 Central China Real Estate Ltd 7.25% 24/4/2023	194,827	0.00
USD	300,000 CFLD Cayman Investment Ltd 7.125% 8/4/2022*	302,250	0.00
USD	2,024,000 CFLD Cayman Investment Ltd 8.6% 8/4/2024	2,036,255	0.02
USD	1,797,000 CFLD Cayman Investment Ltd 8.625% 28/2/2021	1,839,679	0.02
USD	2,400,000 China Aoyuan Group Ltd 4.8% 18/2/2021*	2,403,000	0.02
USD	5,202,000 China Aoyuan Group Ltd 7.95% 19/2/2023	5,488,110	0.05
HKD	22,000,000 China Education Group Holdings Ltd 2% 28/3/2024	2,961,611	0.03
HKD	58,000,000 China Evergrande Group 4.25% 14/2/2023	6,979,796	0.07
USD	2,464,000 China Evergrande Group 7.5% 28/6/2023	2,136,904	0.02
USD	200,000 China Evergrande Group 9.5% 11/4/2022	192,750	0.00
USD	1,413,000 China Evergrande Group 10% 11/4/2023	1,337,155	0.01
USD	200,000 China Evergrande Group 11.5% 22/1/2023	195,750	0.00
USD	3,424,000 China Evergrande Group 12% 22/1/2024	3,272,574	0.03
USD	3,500,000 China Resources Land Ltd FRN 9/12/2024 (Perpetual)	3,550,313	0.03
USD	2,100,000 China SCE Group Holdings Ltd 7.25% 19/4/2023*	2,128,875	0.02
USD	2,673,000 China SCE Group Holdings Ltd 7.375% 9/4/2024	2,725,172	0.03
USD	1,438,000 China SCE Group Holdings Ltd 7.45% 17/4/2021	1,466,034	0.01
USD	3,800,000 CIFI Holdings Group Co Ltd 5.5% 23/1/2022	3,823,750	0.04
USD	200,000 CIFI Holdings Group Co Ltd 6.55% 28/3/2024	204,500	0.00
USD	2,560,000 CIFI Holdings Group Co Ltd 6.875% 23/4/2021	2,612,672	0.02
USD	300,000 CIFI Holdings Group Co Ltd 7.625% 28/2/2023*	314,250	0.00
USD	200,000 Country Garden Holdings Co Ltd 6.5% 8/4/2024	212,031	0.00
USD	2,413,000 DP World Crescent Ltd 3.908% 31/5/2023	2,498,842	0.02
USD	1,170,000 Energuate Trust ' 144A ' 5.875% 3/5/2027	1,230,369	0.01
USD	3,925,000 Esic Sukuk Ltd 3.939% 30/7/2024	3,900,469	0.04
USD	1,981,000 Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.95% 5/7/2022	1,919,713	0.02
USD	1,780,000 Fantasia Holdings Group Co Ltd 8.375% 8/3/2021	1,805,587	0.02
USD	400,000 Fantasia Holdings Group Co Ltd 11.75% 17/4/2022	421,801	0.00
USD	733,000 FWD Ltd FRN 1/2/2023 (Perpetual)*	714,675	0.01
USD	5,051,000 Grupo Aval Ltd ' 144A ' 4.375% 4/2/2030*	5,088,883	0.05
HKD	33,000,000 Harvest International Co 21/11/2022 (Zero Coupon)	4,403,915	0.04
USD	645,000 Hilong Holding Ltd 8.25% 26/9/2022	646,512	0.01
USD	2,120,000 Jingrui Holdings Ltd 9.45% 23/4/2021	2,064,350	0.02
USD	556,000 JOYY Inc ' 144A ' 0.75% 15/6/2025	514,491	0.00
USD	1,655,000 Kaisa Group Holdings Ltd 6.75% 18/2/2021	1,648,794	0.02
USD	1,398,000 Kaisa Group Holdings Ltd 8.5% 30/6/2022	1,393,334	0.01
USD	200,000 Kaisa Group Holdings Ltd 11.5% 30/1/2023	205,818	0.00
USD	1,700,000 Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 22/10/2022*	1,796,008	0.02
USD	2,006,000 King Talent Management Ltd FRN 4/12/2022 (Perpetual)	1,913,849	0.02
USD	200,000 KWG Group Holdings Ltd 7.875% 1/9/2023	206,000	0.00
USD	514,000 Latam Finance Ltd ' 144A ' 6.875% 11/4/2024	519,140	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 200,000	Lima Metro Line 2 Finance Ltd '144A' 4.35% 5/4/2036	218,850	0.00
USD 200,000	Logan Property Holdings Co Ltd 6.5% 16/7/2023	204,406	0.00
USD 1,545,000	Longfor Group Holdings Ltd 3.95% 16/9/2029	1,600,523	0.02
USD 306,000	Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5.375% 4/12/2029	308,954	0.00
USD 200,000	Melco Resorts Finance Ltd 5.625% 17/7/2027	204,750	0.00
USD 665,000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.375% 15/5/2024	689,210	0.01
USD 665,000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5.875% 15/5/2026	689,926	0.01
USD 1,250,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd FRN 15/1/2028	1,247,180	0.01
USD 1,177,075	Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd '144A' 6.35% 1/12/2021	1,177,558	0.01
USD 1,561,712	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd '144A' 6.72% 1/12/2022	1,549,511	0.01
USD 58,776	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd '144A' 7.72% 1/12/2026	13,535	0.00
USD 289,000	Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd '144A' 30/3/2020 (Perpetual) (Zero Coupon)	2,745	0.00
USD 5,000,000	OFSI Fund VI Ltd FRN 20/3/2025	4,952,756	0.05
USD 7,135,000	OZLM XIX Ltd FRN 22/11/2030	7,032,979	0.07
USD 3,250,000	Parallel 2015-1 Ltd FRN 0/7/2027	3,221,833	0.03
USD 580,000	Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	565,922	0.01
USD 1,434,717	Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	1,435,742	0.01
USD 2,200,000	Pearl Holding III Ltd 9.5% 11/12/2022	1,228,142	0.01
USD 8,000,000	Poseidon Finance 1 Ltd 1/2/2025 (Zero Coupon)	8,026,000	0.08
USD 1,575,000	Powerlong Real Estate Holdings Ltd 7.125% 8/11/2022	1,588,781	0.02
USD 2,400,000	Redsun Properties Group Ltd 11.5% 4/3/2021	2,478,375	0.02
USD 1,580,000	Ronshine China Holdings Ltd 8.75% 25/10/2022	1,651,100	0.02
USD 1,760,000	Ronshine China Holdings Ltd 8.95% 22/1/2023	1,863,956	0.02
USD 845,000	Ronshine China Holdings Ltd 10.5% 1/3/2022*	906,923	0.01
USD 760,000	Ronshine China Holdings Ltd 11.25% 22/8/2021	814,150	0.01
USD 1,943,000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4 4.222% 27/1/2024	2,072,695	0.02
USD 970,000	Seazen Group Ltd 6.5% 12/9/2020*	973,637	0.01
USD 2,000,000	Seazen Group Ltd 7.5% 22/1/2021	2,025,000	0.02
USD 2,000,000	Shui On Development Holding Ltd FRN 4/6/2020 (Perpetual)	2,021,112	0.02
USD 300,000	Shui On Development Holding Ltd 5.75% 12/11/2023	305,625	0.00
EUR 3,414,000	Sino Biopharmaceutical Ltd 17/2/2025 (Zero Coupon)	3,735,981	0.04
USD 299,305	SPARC EM SPC Panama Metro Line 2 SP 5/12/2022 (Zero Coupon)	287,473	0.00
USD 1,550,000	Sunac China Holdings Ltd 7.25% 14/6/2022	1,588,750	0.02
USD 2,300,000	Sunac China Holdings Ltd 7.5% 1/2/2024	2,316,163	0.02
USD 200,000	Sunac China Holdings Ltd 7.875% 15/2/2022	206,500	0.00
USD 4,000,000	Tencent Holdings Ltd 3.975% 11/4/2029*	4,463,141	0.04
USD 1,548,000	Times China Holdings Ltd 5.75% 26/4/2022*	1,549,331	0.01
USD 200,000	Times China Holdings Ltd 6.75% 16/7/2023	203,844	0.00
USD 2,300,000	Times China Holdings Ltd 7.625% 21/2/2022	2,357,500	0.02
GBP 800,000	Trafford Centre Finance Ltd/The FRN 28/7/2035	979,849	0.01
USD 910,985	Transocean Guardian Ltd '144A' 5.875% 15/1/2024	904,235	0.01
USD 6,953,800	Transocean Phoenix 2 Ltd '144A' 7.75% 15/10/2024	7,130,531	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD	620,200 Transocean Proteus Ltd '144A' 6.25% 1/12/2024	628,210	0.01
EUR	330,000 UPCB Finance VII Ltd 3.625% 15/6/2029	369,925	0.00
USD	440,000 Vale Overseas Ltd 6.25% 10/8/2026	517,000	0.01
USD	781,000 Wynn Macau Ltd '144A' 4.875% 1/10/2024	782,230	0.01
USD	340,000 Wynn Macau Ltd '144A' 5.125% 15/12/2029*	333,237	0.00
USD	665,000 Wynn Macau Ltd '144A' 5.5% 1/10/2027*	669,447	0.01
USD	200,000 Wynn Macau Ltd 5.5% 1/10/2027	201,337	0.00
USD	1,442,000 Xinyuan Real Estate Co Ltd 9.875% 19/3/2020*	1,423,254	0.01
USD	2,400,000 Yankuang Group Cayman Ltd 4.75% 30/11/2020	2,411,712	0.02
USD	1,760,000 Yuzhou Properties Co Ltd 6% 25/10/2023	1,717,650	0.02
USD	2,155,000 Yuzhou Properties Co Ltd 8.5% 26/2/2024*	2,251,975	0.02
USD	975,000 Zhenro Properties Group Ltd 5.6% 28/2/2021	973,173	0.01
USD	1,400,000 Zhenro Properties Group Ltd 8.7% 3/8/2022	1,444,324	0.01
USD	200,000 Zhenro Properties Group Ltd 9.15% 8/3/2022	207,250	0.00
USD	1,805,000 Zhenro Properties Group Ltd 9.15% 6/5/2023	1,863,514	0.02
		183,690,462	1.75
チリ			
CLP	1,420,000,000 Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4.5% 1/3/2026	1,864,070	0.02
USD	2,131,000 Celulosa Arauco y Constitucion SA '144A' 4.2% 29/1/2030	2,203,920	0.02
USD	200,000 Celulosa Arauco y Constitucion SA 4.2% 29/1/2030	206,844	0.00
USD	1,829,000 Celulosa Arauco y Constitucion SA '144A' 4.25% 30/4/2029	1,904,629	0.02
USD	218,000 Chile Government International Bond 2.25% 30/10/2022*	220,847	0.00
USD	958,000 Chile Government International Bond 3.125% 27/3/2025	1,010,930	0.01
USD	328,000 Chile Government International Bond 3.125% 21/1/2026	347,987	0.00
USD	1,003,000 Chile Government International Bond 3.24% 6/2/2028	1,083,397	0.01
USD	2,695,000 Embotelladora Andina SA '144A' 3.95% 21/1/2050	2,720,603	0.03
USD	522,000 Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA '144A' 5% 25/1/2047	621,996	0.01
USD	1,793,000 Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA '144A' 4.75% 1/8/2026	1,933,919	0.02
USD	516,000 EneI Americas SA 4% 25/10/2026	556,522	0.00
USD	739,000 GNL Quintero SA 4.634% 31/7/2029	799,390	0.01
USD	274,000 Inversiones CMPC SA '144A' 3.85% 13/1/2030	282,562	0.00
		15,757,616	0.15
中国			
CNY	30,000,000 Central Huijin Investment Ltd 3.83% 22/5/2024	4,406,621	0.04
EUR	2,600,000 Chengdu Xingcheng Investment Group Co Ltd 2.5% 20/3/2021	2,829,285	0.03
USD	2,470,000 China Construction Bank Corp FRN 27/2/2029	2,643,286	0.03
CNY	78,000,000 China Development Bank 3.3% 1/2/2024	11,349,306	0.11
CNY	167,540,000 China Development Bank 3.45% 20/9/2029	24,459,095	0.23
CNY	65,300,000 China Development Bank 3.5% 13/8/2026	9,519,941	0.09
CNY	37,000,000 China Development Bank 3.68% 26/2/2026	5,450,374	0.05
CNY	36,800,000 China Development Bank 4.04% 6/7/2028	5,550,651	0.05
CNY	78,330,000 China Government Bond 3.12% 5/12/2026	11,457,722	0.11

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
中国(続き)			
CNY 160,780,000	China Government Bond 3.13% 21/11/2029	23,779,036	0.23
CNY 48,000,000	China Government Bond 3.19% 11/4/2024	7,047,192	0.07
CNY 61,900,000	China Government Bond 3.22% 6/12/2025	9,095,990	0.09
CNY 88,800,000	China Government Bond 3.25% 22/11/2028	13,137,031	0.12
CNY 485,270,000	China Government Bond 3.29% 23/5/2029	72,371,309	0.69
CNH 10,000,000	China Government Bond 3.3% 4/7/2023	1,468,070	0.01
CNY 134,050,000	China Government Bond 3.86% 22/7/2049	20,930,444	0.20
CNY 97,400,000	China Government Bond 4.08% 22/10/2048	15,605,741	0.15
USD 947,000	China Minmetals Corp FRN 13/11/2022 (Perpetual)	963,425	0.01
CNY 30,000,000	China National Petroleum Corp 4.16% 16/8/2025	4,451,872	0.04
CNY 30,000,000	China Southern Power Grid Co Ltd 3.76% 14/1/2024	4,397,314	0.04
CNY 20,000,000	China State Railway Group Co Ltd 4.88% 17/10/2024	3,062,634	0.03
CNY 10,000,000	China State Railway Group Co Ltd 5.42% 27/5/2024	1,562,522	0.01
USD 2,000,000	Guangxi Financial Investment Group Co Ltd 5.75% 23/1/2021	1,904,414	0.02
USD 1,032,000	Huachen Energy Co Ltd (Defaulted) 6.625% 18/5/2020	423,926	0.00
USD 687,000	Inner Mongolia High-Grade High Way Construction And Development Co Ltd 4.375% 4/12/2020	686,492	0.01
CNY 20,000,000	PetroChina Co Ltd 3.66% 22/2/2024	2,910,310	0.03
CNY 30,000,000	PetroChina Co Ltd 3.96% 23/4/2024	4,427,856	0.04
CNY 10,000,000	State Grid Corp of China 5.38% 19/8/2024	1,546,626	0.01
USD 1,157,000	Union Life Insurance Co Ltd 3% 19/9/2021	934,567	0.01
USD 2,440,000	Zhengzhou Real Estate Group Co Ltd 3.95% 9/10/2022	2,465,925	0.02
		270,838,977	2.57
コロンビア			
USD 232,000	Bancolumbia SA FRN 18/12/2029	238,380	0.00
USD 3,223,000	Bancolumbia SA 3% 29/1/2025	3,235,086	0.03
USD 329,000	Colombia Government International Bond 3% 30/1/2030	332,292	0.00
USD 1,045,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	1,124,845	0.01
USD 657,000	Colombia Government International Bond 4% 26/2/2024	698,576	0.01
USD 11,647,000	Colombia Government International Bond 4.375% 12/7/2021	12,034,627	0.11
USD 2,336,000	Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026	2,578,725	0.02
USD 4,141,000	Colombia Government International Bond 4.5% 15/3/2029	4,689,682	0.05
USD 1,361,000	Colombia Government International Bond 8.125% 2 1/5/2024	1,684,450	0.02
COP 31,349,000,000	Colombian TES 7% 30/6/2032	9,510,770	0.09
COP 14,176,700,000	Colombian TES 10% 24/7/2024	4,784,036	0.05
USD 1,997,000	Ecopetrol SA 5.375% 26/6/2026	2,241,008	0.02
USD 1,967,000	Ecopetrol SA 5.875% 28/5/2045	2,356,404	0.02
USD 1,430,000	Ecopetrol SA 7.375% 18/9/2043	1,972,953	0.02
USD 2,088,000	Empresas Publicas de Medellin ESP ' 144A ' 4.25% 18/7/2029	2,193,705	0.02
USD 639,000	SURA Asset Management SA ' 144A ' 4.875% 17/4/2024	691,019	0.01
		50,366,558	0.48

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
クロアチア			
USD	500,000 Croatia Government International Bond 6.625% 14/7/2020	508,437	0.01
デンマーク			
EUR	880,000 DSV PANALPINA A/S 0.375% 26/2/2027	968,192	0.01
ドミニカ共和国			
USD	943,000 Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA ' 144A ' 6.75% 30/3/2029	1,051,176	0.01
USD	235,000 Dominican Republic International Bond ' 144A ' 4.5% 30/1/2030	235,823	0.00
USD	918,000 Dominican Republic International Bond 5.5% 27/1/2025	987,854	0.01
USD	2,757,000 Dominican Republic International Bond 6% 19/7/2028*	3,057,809	0.03
USD	262,000 Dominican Republic International Bond 6.875% 29/1/2026	299,499	0.00
		5,632,161	0.05
エクアドル			
USD	2,353,000 Ecuador Government International Bond 7.875% 23/1/2028	1,680,189	0.02
エジプト			
EGP	14,000,000 Egypt Government Bond 14.3% 3/9/2022	908,941	0.01
EGP	4,000,000 Egypt Government Bond 14.35% 10/9/2024	257,093	0.00
EGP	16,885,000 Egypt Government Bond 15.9% 2/7/2024	1,138,923	0.01
EGP	10,000,000 Egypt Government Bond 16% 11/6/2022	661,074	0.01
EGP	163,844,000 Egypt Government Bond 16.1% 7/5/2029	11,450,560	0.11
USD	908,000 Egypt Government International Bond ' 144A ' 5.577% 21/2/2023	934,105	0.01
EUR	3,981,000 Egypt Government International Bond 5.625% 16/4/2030	4,411,307	0.04
USD	1,597,000 Egypt Government International Bond 5.75% 29/4/2020	1,608,478	0.02
USD	351,000 Egypt Government International Bond ' 144A ' 5.75% 29/4/2020	353,523	0.00
USD	864,000 Egypt Government International Bond 6.125% 31/1/2022	898,155	0.01
USD	324,000 Egypt Government International Bond ' 144A ' 6.125% 31/1/2022	336,808	0.00
EUR	4,044,000 Egypt Government International Bond ' 144A ' 6.375% 11/4/2031	4,629,425	0.04
USD	2,300,000 Egypt Government International Bond 6.875% 30/4/2040	2,249,688	0.02
USD	3,414,000 Egypt Government International Bond 7.5% 31/1/2027	3,821,546	0.04
USD	318,000 Egypt Government International Bond ' 144A ' 7.6% 1/3/2029	343,341	0.00
USD	883,000 Egypt Government International Bond ' 144A ' 8.15% 20/11/2059	902,868	0.01
USD	998,000 Egypt Government International Bond ' 144A ' 8.5% 31/1/2047	1,075,189	0.01
EGP	21,250,000 Egypt Treasury Bills 26/5/2020 (Zero Coupon)	1,319,043	0.01
EGP	175,800,000 Egypt Treasury Bills 28/7/2020 (Zero Coupon)	10,689,418	0.10
EGP	82,900,000 Egypt Treasury Bills 18/8/2020 (Zero Coupon)	4,998,740	0.05
		52,988,225	0.50
フィンランド			
EUR	650,000 Citycon Oyj FRN 24/11/2024 (Perpetual)	702,941	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		フィンランド(続き)		
USD	1,250,000	Nordea Bank Abp '144A' FRN 26/3/2026 (Perpetual)	1,399,481	0.01
			2,102,422	0.02
		フランス		
EUR	1,945,000	Altice France SA/France 2.125% 15/2/2025	2,049,955	0.02
EUR	4,155,000	Altice France SA/France 2.5% 15/1/2025	4,468,256	0.04
EUR	2,478,000	Altice France SA/France 3.375% 15/1/2028	2,720,986	0.03
EUR	1,400,000	Altice France SA/France 5.875% 1/2/2027	1,675,052	0.02
USD	2,155,000	Altice France SA/France '144A' 7.375% 1/5/2026	2,293,674	0.02
USD	728,000	Altice France SA/France '144A' 8.125% 1/2/2027	801,310	0.01
EUR	1,422,000	Banijay Entertainment SASU 3.5% 1/3/2025	1,578,453	0.02
EUR	2,200,000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.125% 5/2/2024	2,417,041	0.02
GBP	1,700,000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 5/12/2025	2,157,261	0.02
EUR	200,000	BNP Paribas SA FRN 17/6/2022 (Perpetual)*	241,017	0.00
USD	1,500,000	BNP Paribas SA '144A' FRN 25/3/2024 (Perpetual)*	1,609,792	0.02
EUR	5,100,000	BNP Paribas SA FRN 15/7/2025	5,606,582	0.05
USD	1,800,000	BNP Paribas SA FRN 19/8/2025 (Perpetual)	2,064,501	0.02
USD	5,608,000	BNP Paribas SA '144A' FRN 25/2/2030 (Perpetual)*	5,371,483	0.05
EUR	1,500,000	BPCE SA 0.25% 15/1/2026	1,647,646	0.02
EUR	2,700,000	BPCE SA 0.5% 24/2/2027	2,950,111	0.03
EUR	4,900,000	BPCE SA 0.625% 26/9/2024	5,425,383	0.05
GBP	2,000,000	BPCE SA 1.375% 23/12/2026	2,566,639	0.02
EUR	400,000	Casino Guichard Perrachon SA FRN 31/1/2024 (Perpetual)	232,320	0.00
EUR	300,000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 7/2/2025	257,469	0.00
EUR	300,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.498% 7/3/2024	278,034	0.00
EUR	500,000	CMA CGM SA 6.5% 15/7/2022*	422,069	0.00
EUR	200,000	CMA CGM SA 7.75% 15/1/2021*	193,582	0.00
EUR	100,000	Credit Agricole Assurances SA FRN 14/10/2025 (Perpetual)	123,336	0.00
EUR	1,427,000	Credit Agricole SA FRN 23/6/2021 (Perpetual)	1,659,011	0.02
EUR	682,000	Crown European Holdings SA 0.75% 15/2/2023	738,254	0.01
EUR	334,000	Crown European Holdings SA '144A' 2.25% 1/2/2023	382,545	0.00
EUR	700,000	Crown European Holdings SA 2.25% 1/2/2023	801,742	0.01
EUR	227,000	Crown European Holdings SA 3.375% 15/5/2025	274,119	0.00
EUR	900,000	Electricite de France SA FRN 4/7/2024 (Perpetual)	1,064,836	0.01
EUR	1,600,000	Electricite de France SA FRN 29/1/2025 (Perpetual)	2,007,787	0.02
EUR	700,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2026 (Perpetual)	878,732	0.01
GBP	900,000	Electricite de France SA FRN 29/1/2026 (Perpetual)	1,280,988	0.01
EUR	1,000,000	Electricite de France SA FRN 3/9/2027 (Perpetual)*	1,143,576	0.01
EUR	4,100,000	Electricite de France SA FRN 9/12/2049	4,828,205	0.05
EUR	400,000	Engie SA FRN 2/6/2024 (Perpetual)	481,857	0.01
EUR	2,000,000	Engie SA FRN 28/11/2024 (Perpetual)	2,369,044	0.02
EUR	5,600,000	Engie SA 4/3/2027 (Zero Coupon)	6,136,776	0.06
EUR	400,000	FCT Autonoria 2019 FRN 25/9/2035	441,761	0.00
EUR	600,000	FCT Autonoria 2019 FRN 25/9/2035	658,924	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フランス(続き)			
EUR	500,000 FCT Autonomia 2019 FRN 25/9/2035	549,085	0.01
EUR	500,000 FCT Autonomia 2019 FRN 25/9/2035	549,120	0.01
EUR	1,207,380 FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	1,332,111	0.01
EUR	1,278,403 FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	1,411,041	0.01
EUR	4,930,800 French Republic Government Bond OAT '144A' 1.5% 25/5/2050	7,053,927	0.07
EUR	4,400,000 HSBC France SA 0.25% 17/5/2024	4,855,847	0.05
EUR	206,000 Kapla Holding SAS FRN 15/12/2026	227,846	0.00
EUR	248,000 Kapla Holding SAS 3.375% 15/12/2026	267,349	0.00
EUR	472,000 Loxam SAS 3.25% 14/1/2025	524,151	0.01
EUR	167,000 Loxam SAS 3.5% 15/4/2022	184,983	0.00
EUR	200,000 Loxam SAS 3.5% 3/5/2023	221,839	0.00
EUR	444,000 Loxam SAS 3.75% 15/7/2026	504,014	0.01
EUR	200,000 Loxam SAS 4.25% 15/4/2024	224,002	0.00
EUR	900,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE FRN 11/2/2022	992,565	0.01
EUR	4,200,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 11/2/2024 (Zero Coupon)	4,611,519	0.04
EUR	6,700,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 11/2/2026 (Zero Coupon)	7,323,623	0.07
EUR	6,200,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.125% 11/2/2028	6,751,652	0.06
EUR	4,800,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.375% 11/2/2031	5,234,561	0.05
GBP	1,700,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 1% 11/2/2023	2,180,422	0.02
GBP	9,200,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 1.125% 11/2/2027	11,707,502	0.11
EUR	1,000,000 Novafives SAS 5% 15/6/2025	922,194	0.01
GBP	1,120,000 Orange SA 5.25% 5/12/2025	1,756,471	0.02
EUR	1,000,000 Pernod Ricard SA 0.5% 24/10/2027	1,114,372	0.01
EUR	1,300,000 Picard Groupe SAS FRN 30/11/2023	1,351,015	0.01
EUR	200,000 Quatrim SASU 5.875% 15/1/2024	219,248	0.00
EUR	280,000 Rexel SA 2.625% 15/6/2024*	310,725	0.00
EUR	1,000,000 Societe Generale SA FRN 7/4/2021 (Perpetual)	1,156,379	0.01
USD	248,000 Societe Generale SA '144A' FRN 13/9/2021 (Perpetual)*	260,580	0.00
EUR	1,700,000 Societe Generale SA 0.125% 24/2/2026	1,860,330	0.02
EUR	4,000,000 Societe Generale SA 0.5% 13/1/2023	4,424,559	0.04
GBP	2,900,000 Societe Generale SA 1.875% 3/10/2024	3,789,808	0.04
EUR	1,400,000 Solvay Finance SA FRN 12/11/2023 (Perpetual)	1,732,741	0.02
EUR	600,000 SPIE SA 2.625% 18/6/2026	679,277	0.01
EUR	2,900,000 Thales SA 0.75% 23/1/2025	3,280,598	0.03
EUR	100,000 TOTAL SA FRN 26/2/2021 (Perpetual)	111,184	0.00
EUR	160,000 TOTAL SA FRN 5/5/2023 (Perpetual)	184,259	0.00
EUR	200,000 Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.75% 1/7/2049	214,584	0.00
GBP	1,800,000 Vinci SA 2.25% 15/3/2027	2,475,515	0.02
		156,851,107	1.49
ドイツ			
EUR	400,000 ADLER Real Estate AG 1.875% 27/4/2023	447,602	0.00
EUR	1,700,000 ADLER Real Estate AG 3% 27/4/2026*	1,971,820	0.02
GBP	1,345,000 BASF SE 1.75% 11/3/2025	1,790,187	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ドイツ(続き)			
EUR	900,000 Bayer AG FRN 1/7/2074	1,050,599	0.01
EUR	700,000 Bayer AG FRN 12/11/2079	768,629	0.01
EUR	600,000 Bayer AG FRN 12/11/2079	674,806	0.01
EUR	1,282,000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.5% 11/2/2027	1,421,067	0.01
EUR	100,000 Consus Real Estate AG 4% 29/11/2022	108,636	0.00
EUR	281,000 Consus Real Estate AG 9.625% 15/5/2024	337,360	0.00
GBP	1,125,000 Deutsche Bahn Finance GMBH 1.875% 13/2/2026	1,517,469	0.01
USD	1,400,000 Deutsche Bank AG FRN 30/10/2025 (Perpetual)	1,335,593	0.01
EUR	12,472,000 Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026	15,870,899	0.15
EUR	2,400,000 Deutsche Pfandbriefbank AG FRN 28/4/2023 (Perpetual)	2,760,595	0.03
EUR	100,000 Deutsche Pfandbriefbank AG 4.6% 22/2/2027	121,768	0.00
EUR	4,025,000 E.ON SE 18/12/2023 (Zero Coupon)	4,420,255	0.04
EUR	879,000 IHO Verwaltungs GmbH 3.625% 15/5/2025*	973,994	0.01
EUR	855,000 IHO Verwaltungs GmbH 3.875% 15/5/2027*	949,136	0.01
USD	200,000 IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6% 15/5/2027	209,569	0.00
EUR	2,600,000 IKB Deutsche Industriebank AG FRN 31/1/2028	2,880,471	0.03
EUR	500,000 Infineon Technologies AG FRN 1/1/2025 (Perpetual)	548,088	0.01
EUR	300,000 Infineon Technologies AG FRN 1/1/2028 (Perpetual)*	332,884	0.00
EUR	1,100,000 LEG Immobilien AG 0.875% 28/11/2027	1,242,802	0.01
EUR	1,600,000 Merck Financial Services GmbH 0.125% 16/7/2025	1,763,113	0.02
EUR	3,400,000 Merck KGaA FRN 25/6/2079*	3,984,044	0.04
EUR	200,000 Nidda BondCo GmbH 5% 30/9/2025	222,329	0.00
EUR	599,000 Nidda BondCo GmbH 7.25% 30/9/2025	687,684	0.01
EUR	1,599,000 Nidda Healthcare Holding GmbH 3.5% 30/9/2024	1,762,563	0.02
EUR	1,552,000 Nidda Healthcare Holding GmbH 3.5% 30/9/2024	1,732,561	0.02
EUR	435,000 Peach Property Finance GmbH 3.5% 15/2/2023	495,036	0.00
EUR	267,000 Platin 1426 GmbH 5.375% 15/6/2023	275,072	0.00
EUR	1,250,000 RWE AG FRN 21/4/2075	1,383,142	0.01
EUR	700,000 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	824,958	0.01
EUR	500,000 Tele Columbus AG 3.875% 2/5/2025	522,802	0.00
EUR	1,215,000 thyssenkrupp AG 1.875% 6/3/2023	1,317,509	0.01
EUR	100,000 thyssenkrupp AG 2.5% 25/2/2025	107,538	0.00
EUR	5,330,000 thyssenkrupp AG 2.875% 22/2/2024	5,861,707	0.06
EUR	2,700,000 Volkswagen Financial Services AG 1.5% 1/10/2024	3,066,920	0.03
EUR	265,000 WEPA Hygieneprodukte GmbH FRN 15/12/2026*	295,579	0.00
EUR	659,000 WEPA Hygieneprodukte GmbH 2.875% 15/12/2027	734,198	0.01
		66,770,984	0.63
ガーナ			
USD	5,242,000 Ghana Government International Bond '144A' 6.375% 11/2/2027*	5,256,154	0.05
USD	2,348,000 Ghana Government International Bond '144A' 8.75% 11/3/2061*	2,347,859	0.02
		7,604,013	0.07
ギリシャ			
EUR	6,085,000 Hellenic Republic Government Bond '144A' 1.875% 23/7/2026	7,090,523	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ギリシャ(続き)			
EUR	9,340,000 Hellenic Republic Government Bond ' 144A ' 3.45% 2/4/2024	11,429,810	0.11
EUR	1,463,760 Hellenic Republic Government Bond 3.5% 30/1/2023	1,750,488	0.02
EUR	2,987,600 Hellenic Republic Government Bond 3.75% 30/1/2028	3,922,961	0.04
EUR	19,893,000 Hellenic Republic Government Bond ' 144A ' 3.875% 12/3/2029	26,615,960	0.25
EUR	415,360 Hellenic Republic Government Bond 3.9% 30/1/2033	572,803	0.01
EUR	331,133 Hellenic Republic Government Bond 4% 30/1/2037	473,104	0.00
EUR	974,923 Hellenic Republic Government Bond 4.2% 30/1/2042	1,492,100	0.01
		53,347,749	0.51
ガーンジー			
USD	371,092 Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust ' 144A ' 5.25% 30/5/2023	387,047	0.00
EUR	636,000 Summit Properties Ltd 2% 31/1/2025	692,725	0.01
		1,079,772	0.01
香港			
USD	250,000 Bank of East Asia Ltd/The FRN 19/9/2024 (Perpetual)	261,875	0.00
CNH	917,253 China City Construction International Co Ltd (Defaulted) 5.35% 3/7/2017	7,872	0.00
USD	250,000 Chong Hing Bank Ltd FRN 15/7/2024 (Perpetual)	260,195	0.00
USD	2,695,000 CITIC Ltd 2.85% 25/2/2030	2,720,706	0.03
USD	5,555,000 CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.625% 14/3/2023	5,921,371	0.06
USD	6,047,000 CNAC HK Synbridge Co Ltd 5% 5/5/2020	6,088,210	0.06
USD	2,775,000 GLP China Holdings Ltd 4.974% 26/2/2024	2,985,727	0.03
USD	2,443,000 HBIS Group Hong Kong Co Ltd 4.25% 7/4/2020	2,445,290	0.02
USD	230,000 Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd/The FRN 27/4/2020 (Perpetual)	200,118	0.00
USD	200,000 Nanyang Commercial Bank Ltd FRN 2/6/2022 (Perpetual)	203,656	0.00
USD	3,905,000 Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 3.15% 12/5/2025	4,007,248	0.04
USD	2,600,000 Viva Incubator Investment Management Ltd 2.5% 11/2/2025	2,518,750	0.02
USD	1,605,000 Wanda Group Overseas Ltd 7.5% 24/7/2022	1,548,825	0.01
USD	1,846,000 Weichai International Hong Kong Energy Group Co Ltd FRN 14/9/2022 (Perpetual)	1,862,441	0.02
USD	200,000 Yanlord Land HK Co Ltd 6.75% 23/4/2023	206,000	0.00
USD	1,790,000 Yanlord Land HK Co Ltd 6.8% 27/2/2024*	1,835,030	0.02
		33,073,314	0.31
インド			
USD	3,430,000 Adani Electricity Mumbai Ltd ' 144A ' 3.949% 12/2/2030*	3,514,321	0.03
USD	3,335,000 Adani Electricity Mumbai Ltd 3.949% 12/2/2030	3,366,707	0.03
USD	200,000 Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 4% 30/7/2027	208,375	0.00
USD	3,050,000 Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 4.375% 3/7/2029	3,223,469	0.03
USD	1,089,000 Adani Renewable Energy RJ Ltd/Kodangal Solar Parks Pvt Ltd/Wardha Solar Maharash 4.625% 15/10/2039	1,109,136	0.01
USD	2,167,000 Adani Transmission Ltd 4% 3/8/2026	2,255,311	0.02
USD	3,818,000 Adani Transmission Ltd 4.25% 21/5/2036	3,916,542	0.04
USD	6,500,000 Bharti Airtel Ltd 1.5% 17/2/2025	7,190,625	0.07
USD	3,670,000 Future Retail Ltd ' 144A ' 5.6% 22/1/2025*	3,679,175	0.03
USD	200,000 HPCL-Mittal Energy Ltd 5.45% 22/10/2026	205,942	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
インド(続き)			
INR 1,500,430,000	India Government Bond 7.17% 8/1/2028	21,587,239	0.21
INR 7,266,470,000	India Government Bond 7.27% 8/4/2026	105,803,992	1.01
INR 3,246,420,000	India Government Bond 7.32% 28/1/2024	47,249,503	0.45
INR 378,000,000	Indian Railway Finance Corp Ltd 8.45% 4/12/2028	5,661,753	0.05
USD 3,669,000	Muthoot Finance Ltd '144A' 6.125% 31/10/2022	3,794,792	0.04
INR 341,000,000	NHPC Ltd 8.12% 22/3/2029	4,960,083	0.05
USD 2,710,000	Oil India Ltd 5.125% 4/2/2029	3,070,345	0.03
USD 2,740,000	Power Finance Corp Ltd 3.75% 18/6/2024	2,833,420	0.03
USD 4,093,000	Power Finance Corp Ltd 3.75% 6/12/2027	4,131,423	0.04
USD 2,442,000	Power Finance Corp Ltd 4.5% 18/6/2029	2,576,310	0.02
INR 500,000,000	Power Finance Corp Ltd 7.44% 11/6/2027	7,103,702	0.07
USD 2,462,000	REC Ltd 4.625% 22/3/2028*	2,609,720	0.02
USD 2,600,000	ReNew Power Pvt Ltd 6.45% 27/9/2022	2,687,344	0.03
USD 2,400,000	ReNew Power Synthetic 6.67% 12/3/2024*	2,501,748	0.02
USD 200,000	ReNew Power Synthetic '144A' 6.67% 12/3/2024	208,250	0.00
USD 1,500,000	Suzlon Energy Ltd (Step-up coupon) (Defaulted) 5.75% 16/7/2019	525,000	0.01
USD 116,049	Videocon Industries Ltd (Restricted) (Step-up coupon) 2.8% 31/12/2020	35,962	0.00
		246,010,189	2.34
インドネシア			
EUR 461,000	Indonesia Government International Bond 0.9% 14/2/2027	508,444	0.00
USD 639,000	Indonesia Government International Bond 3.5% 11/1/2028	676,947	0.01
USD 6,025,000	Indonesia Government International Bond 3.7% 8/1/2022	6,214,787	0.06
USD 11,951,000	Indonesia Government International Bond 3.75% 25/4/2022	12,406,632	0.12
USD 1,128,000	Indonesia Government International Bond 4.1% 24/4/2028	1,253,542	0.01
USD 1,325,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 8/1/2026	1,491,246	0.01
USD 4,885,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 11/2/2029	5,713,549	0.05
USD 11,647,000	Indonesia Government International Bond 4.875% 5/5/2021	12,064,890	0.11
USD 1,204,000	Indonesia Government International Bond 5.875% 13/3/2020	1,208,891	0.01
IDR 161,154,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15/5/2028	10,530,187	0.10
IDR 33,678,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.625% 15/5/2033	2,159,523	0.02
IDR 47,484,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/5/2027	3,367,483	0.03
IDR 109,589,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/9/2030	7,781,410	0.07
IDR 316,861,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/6/2035	22,062,667	0.21
IDR 196,036,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/5/2038	13,355,998	0.13
IDR 714,931,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2029	53,641,621	0.51
IDR 114,594,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	8,674,320	0.08
IDR 95,105,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/9/2026	7,258,405	0.07
IDR 207,679,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2034	15,415,795	0.15
IDR 295,025,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/4/2039	21,847,990	0.21
IDR 66,439,000,000	Indonesia Treasury Bond 9% 15/3/2029	5,151,656	0.05
USD 6,650,000	Pertamina Persero PT 4.175% 21/1/2050	6,832,733	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
インドネシア(続き)			
USD 1,525,000	Pertamina Persero PT 4.7% 30/7/2049	1,699,551	0.02
USD 2,225,000	Perusahaan Listrik Negara PT 4.875% 17/7/2049*	2,477,921	0.02
IDR 28,140,000,000	Wijaya Karya Persero Tbk PT 7.7% 31/1/2021	1,872,901	0.02
		225,669,089	2.14
アイルランド			
EUR 200,000	AIB Group Plc FRN 9/10/2024 (Perpetual)	226,320	0.00
EUR 3,152,000	Allied Irish Banks Plc FRN 3/12/2020 (Perpetual)	3,619,358	0.03
USD 483,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc ' 144A ' 4.125% 15/8/2026	490,184	0.01
USD 3,206,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc ' 144A ' 4.25% 15/9/2022	3,223,655	0.03
GBP 2,092,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.75% 15/7/2027	2,769,836	0.03
USD 335,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc ' 144A ' 5.25% 15/8/2027	342,256	0.00
USD 709,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc ' 144A ' 6% 15/2/2025	738,112	0.01
USD 5,648,000	ASG Finance Designated Activity Co ' 144A ' 7.875% 3/12/2024	5,436,200	0.05
EUR 150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	157,638	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	161,948	0.00
EUR 550,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	420,593	0.00
EUR 760,000	Avoca CLO XV DAC FRN 15/4/2031	799,594	0.01
EUR 1,400,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	1,521,683	0.01
EUR 600,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	647,965	0.01
EUR 1,000,000	Bank of Ireland FRN 18/6/2020(Perpetual)*	1,116,489	0.01
GBP 200,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027*	262,733	0.00
USD 1,950,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027*	2,009,329	0.02
USD 1,737,000	C&W Senior Financing DAC ' 144A ' 6.875% 15/9/2027	1,870,441	0.02
EUR 1,000,000	CIFC European Funding CLO FRN 15/4/2033	1,096,780	0.01
EUR 400,000	CIFC European Funding CLO I DAC FRN 15/7/2032	433,267	0.00
EUR 205,000	Contego CLO II BV FRN 15/11/2026	223,500	0.00
EUR 730,000	CVC Cordatus Loan Fund VI DAC FRN 15/4/2032	419,623	0.00
EUR 700,000	Halcyon Loan Advisors European Funding FRN 18/10/2031	768,161	0.01
EUR 500,000	Harvest CLO XXII DAC FRN 15/1/2032	548,393	0.01
EUR 126,000	Harvest CLO XXIII DAC FRN 20/10/2032	134,048	0.00
EUR 710,000	Invesco Euro CLO I DAC FRN 15/7/2031	793,519	0.01
EUR 300,000	Invesco Euro Clo III DAC FRN 15/7/2032	323,343	0.00
EUR 685,000	Invesco Euro Clo III DAC 15/7/2032 (Zero Coupon)	609,885	0.01
EUR 700,000	Invesco Euro CLO IV DAC FRN 15/4/2033	767,746	0.01
EUR 460,000	Madison Park Euro Funding X DAC FRN 25/10/2030	505,871	0.01
EUR 340,000	Madison Park Euro Funding XI DAC FRN 15/2/2031	369,940	0.00
USD 2,956,000	Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC ' 144A ' 4.7% 30/5/2026	3,222,040	0.03
EUR 720,000	OZLME IV DAC FRN 27/7/2032	786,289	0.01
USD 269,000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC ' 144A ' 3.05% 23/1/2025	270,009	0.00
EUR 400,000	Providus Clo III DAC FRN 20/7/2032	433,216	0.00
EUR 330,000	River Green Finance 2020 DAC FRN 22/1/2032	363,688	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
EUR	555,000 River Green Finance 2020 DAC FRN 22/1/2032	611,347	0.01
EUR	1,420,000 Rockford Tower Europe CLO 2018-1 DAC FRN 20/12/2031	1,569,802	0.02
EUR	484,787 Taurus 2019-1 FR DAC FRN 2/2/2031	533,045	0.01
GBP	3,535,000 Taurus 2019-2 UK DAC FRN 17/11/2029	4,539,730	0.04
GBP	2,185,000 Taurus 2019-2 UK DAC FRN 17/11/2029	2,809,649	0.03
GBP	893,000 Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC 5.5% 15/9/2024	1,175,828	0.01
GBP	1,040,000 Virgin Media Receivables Financing Notes II DAC 5.75% 15/4/2023*	1,372,159	0.01
EUR	900,000 Voya Euro CLO I DAC FRN 15/10/2030	987,697	0.01
EUR	200,000 Voya Euro CLO I DAC FRN 15/10/2030	217,607	0.00
EUR	600,000 Voya Euro CLO III DAC FRN 15/4/2033	658,068	0.01
		52,358,584	0.50
イスラエル			
USD	2,816,000 Bank Leumi Le-Israel BM '144A' FRN 29/1/2031	2,823,603	0.03
イタリア			
EUR	300,000 Assicurazioni Generali SpA FRN 21/11/2025 (Perpetual)	359,680	0.00
EUR	403,000 Assicurazioni Generali SpA FRN 27/10/2047	534,545	0.01
EUR	800,000 Assicurazioni Generali SpA FRN 8/6/2048	1,030,973	0.01
EUR	950,000 Assicurazioni Generali SpA 2.124% 1/10/2030	1,066,687	0.01
EUR	300,000 Atlantia SpA 1.625% 3/2/2025	320,446	0.00
EUR	100,000 Atlantia SpA 1.875% 13/7/2027	106,653	0.00
EUR	200,000 Autostrade per l'Italia SpA 4.375% 16/9/2025	244,582	0.00
EUR	2,800,000 Autostrade per l'Italia SpA 5.875% 9/6/2024*	3,525,765	0.03
GBP	200,000 Autostrade per l'Italia SpA 6.25% 9/6/2022	272,804	0.00
EUR	975,000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.625% 28/4/2025	1,091,015	0.01
EUR	530,000 Banco BPM SpA 1.75% 24/4/2023	593,692	0.01
EUR	1,100,000 Banco BPM SpA 2.5% 21/6/2024	1,264,959	0.01
EUR	225,000 Brignole Co 2019-1 SRL FRN 24/7/2034	247,053	0.00
EUR	900,000 Buzzi Unicem SpA 2.125% 28/4/2023*	1,042,192	0.01
EUR	591,000 Diocle Spa FRN 30/6/2026*	647,769	0.01
EUR	4,400,000 Intesa Sanpaolo SpA FRN 16/5/2024 (Perpetual)*	5,157,607	0.05
EUR	7,385,000 Intesa Sanpaolo SpA FRN 11/1/2027 (Perpetual)*	9,699,412	0.09
EUR	150,000 Intesa Sanpaolo SpA 5.15% 16/7/2020	167,044	0.00
EUR	20,325,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 15/9/2022	23,079,469	0.22
EUR	35,135,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.45% 1/3/2036	37,969,529	0.36
EUR	91,810,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.75% 1/7/2024	106,544,092	1.01
EUR	8,145,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.7% 1/3/2047	10,175,962	0.10
EUR	1,830,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.8% 1/3/2067	2,294,807	0.02
EUR	9,030,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.45% 1/3/2048	12,831,485	0.12
EUR	7,660,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.85% 1/9/2049	11,639,658	0.11
EUR	7,935,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 4.75% 1/9/2044	13,377,658	0.13

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
イタリア(続き)			
EUR	1,038,125 Sisal Group SpA 7% 31/7/2023	1,170,077	0.01
EUR	3,567,112 Taurus 2018-1 IT SRL ' Series 2018-IT1 A ' FRN 18/5/2030	3,917,696	0.04
EUR	2,600,000 Telecom Italia SpA/Milano 1.125% 26/3/2022	2,858,043	0.03
EUR	1,699,000 Telecom Italia SpA/Milano 2.75% 15/4/2025	1,974,377	0.02
EUR	200,000 Telecom Italia SpA/Milano 3% 30/9/2025	237,504	0.00
EUR	200,000 Telecom Italia SpA/Milano 3.25% 16/1/2023	234,799	0.00
EUR	2,254,000 Telecom Italia SpA/Milano 4% 11/4/2024	2,707,959	0.03
EUR	280,000 Telecom Italia SpA/Milano 4.875% 25/9/2020	315,126	0.00
USD	1,218,000 Telecom Italia SpA/Milano ' 144A ' 5.303% 30/5/2024	1,306,293	0.01
EUR	1,150,000 UniCredit SpA FRN 10/9/2021 (Perpetual)*	1,321,208	0.01
EUR	1,540,000 UniCredit SpA FRN 3/6/2022 (Perpetual)	1,919,173	0.02
EUR	3,700,000 UniCredit SpA FRN 3/6/2023 (Perpetual)*	4,235,626	0.04
USD	2,200,000 UniCredit SpA FRN 3/6/2024 (Perpetual)*	2,402,125	0.02
EUR	9,085,000 UniCredit SpA FRN 20/1/2026*	10,071,359	0.10
EUR	3,645,000 UniCredit SpA (Restricted) FRN 3/6/2026 (Perpetual)*	4,617,415	0.05
EUR	1,200,000 UniCredit SpA FRN 20/2/2029	1,438,093	0.02
EUR	1,550,000 UniCredit SpA 1% 18/1/2023	1,719,657	0.02
EUR	200,000 Unione di Banche Italiane SpA FRN 4/3/2029	242,114	0.00
		287,974,182	2.74
日本			
JPY	20,000,000 ANA Holdings Inc 16/9/2022 (Zero Coupon)	182,585	0.00
JPY	240,000,000 Daio Paper Corp 17/9/2020 (Zero Coupon)	2,245,479	0.02
JPY	40,000,000 Ezaki Glico Co Ltd 30/1/2024 (Zero Coupon)	368,351	0.00
JPY	150,000,000 HIS Co Ltd 15/11/2024 (Zero Coupon)	1,352,442	0.01
JPY	290,000,000 Iida Group Holdings Co Ltd 18/6/2020 (Zero Coupon)	2,673,208	0.03
JPY	839,800,000 Japan Government Thirty Year Bond 0.4% 20/6/2049	8,015,185	0.08
JPY	936,000,000 Japan Government Thirty Year Bond 0.4% 20/12/2049	8,922,843	0.09
JPY	2,013,400,000 Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2028	19,352,125	0.18
JPY	1,537,800,000 Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2029	14,625,114	0.14
JPY	230,000,000 LIXIL Group Corp 4/3/2020 (Zero Coupon)	2,126,781	0.02
JPY	490,000,000 Mitsubishi Chemical Holdings Corp 30/3/2022 (Zero Coupon)	4,511,196	0.04
JPY	140,000,000 Mitsubishi Chemical Holdings Corp 29/3/2024 (Zero Coupon)	1,298,598	0.01
EUR	1,105,000 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 0.872% 7/9/2024	1,247,312	0.01
EUR	1,145,000 Mizuho Financial Group Inc 0.118% 6/9/2024	1,250,356	0.01
JPY	100,000,000 Rohm Co Ltd 5/12/2024 (Zero Coupon)	949,703	0.01
JPY	180,000,000 SBI Holdings Inc/Japan 13/9/2023 (Zero Coupon)	1,684,145	0.02
USD	600,000 Shizuoka Bank Ltd/The FRN 25/1/2023	554,429	0.01
USD	2,700,000 SoftBank Group Corp FRN 19/7/2023 (Perpetual)*	2,635,484	0.03
EUR	600,000 SoftBank Group Corp 3.125% 19/9/2025	672,799	0.01
EUR	3,905,000 SoftBank Group Corp 4% 20/4/2023	4,549,323	0.04
EUR	3,000,000 SoftBank Group Corp 4% 19/9/2029*	3,461,897	0.03
EUR	300,000 SoftBank Group Corp 4.5% 20/4/2025	360,563	0.00
EUR	1,481,000 SoftBank Group Corp 4.75% 30/7/2025	1,797,306	0.02
EUR	2,000,000 SoftBank Group Corp 5% 15/4/2028	2,431,934	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
日本(続き)			
USD	400,000 SoftBank Group Corp 6% 30/7/2025	428,500	0.00
USD	4,525,000 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.04% 16/7/2029	4,810,750	0.05
JPY	240,000,000 T&D Holdings Inc 5/6/2020 (Zero Coupon)	2,208,213	0.02
JPY	320,000,000 Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2020 (Zero Coupon)	2,938,811	0.03
JPY	120,000,000 Transcosmos Inc 22/12/2020 (Zero Coupon)	1,104,644	0.01
USD	3,000,000 Yamaguchi Financial Group Inc FRN 26/3/2020	3,002,250	0.03
		101,762,326	0.97
ジャージー			
GBP	610,000 AA Bond Co Ltd 4.249% 31/7/2020	789,102	0.01
GBP	6,438,000 CPUK Finance Ltd 4.25% 28/8/2022	8,335,938	0.08
GBP	157,000 CPUK Finance Ltd 4.875% 28/8/2025	205,662	0.00
GBP	362,000 Galaxy Bidco Ltd 6.5% 31/7/2026	489,790	0.00
USD	2,200,000 HBOS Capital Funding LP 6.85% 23/6/2020 (Perpetual)	2,263,250	0.02
GBP	1,900,000 Intu Jersey 2 Ltd 2.875% 1/11/2022	1,743,223	0.02
EUR	4,316,179 LHC3 Plc 4.125% 15/8/2024	4,856,458	0.04
USD	2,000,000 Tullow Oil Jersey Ltd 6.625% 12/7/2021	1,807,060	0.02
		20,490,483	0.19
クウェート			
USD	1,150,000 Burgan Bank SAK FRN 9/7/2024 (Perpetual)	1,182,164	0.01
ルクセンブルグ			
EUR	100,000 Aldesa Financial Services SA 7.25% 1/4/2021	104,674	0.00
USD	7,960,000 Allergan Funding SCS (Restricted) 3.8% 15/3/2025	8,629,293	0.08
EUR	3,360,000 Altice Financing SA 2.25% 15/1/2025	3,562,242	0.03
EUR	2,650,000 Altice Financing SA 3% 15/1/2028	2,813,982	0.03
USD	1,200,000 Altice Financing SA '144A' 7.5% 15/5/2026	1,277,580	0.01
GBP	600,000 B&M European Value Retail SA 4.125% 1/2/2022*	771,596	0.01
EUR	4,690,000 Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 4/6/2026	5,357,832	0.05
EUR	694,000 Cabot Financial Luxembourg II SA FRN 14/6/2024	782,253	0.01
GBP	1,400,000 Cabot Financial Luxembourg SA 7.5% 1/10/2023	1,864,282	0.02
EUR	100,000 Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/5/2025	112,701	0.00
USD	600,000 Cirsa Finance International Sarl '144A' 7.875% 20/12/2023	629,430	0.01
USD	200,000 Codere Finance 2 Luxembourg SA '144A' 7.625% 1/11/2021	183,500	0.00
EUR	1,531,000 ContourGlobal Power Holdings SA 3.375% 1/8/2023	1,710,486	0.02
EUR	1,153,000 ContourGlobal Power Holdings SA 4.125% 1/8/2025	1,316,568	0.01
EUR	1,300,000 DH Europe Finance II Sarl 1.8% 18/9/2049	1,429,642	0.01
USD	2,691,821 Dragon Aviation Finance Luxembourg SA 4% 28/11/2022	2,756,963	0.03
EUR	200,000 E-Carat SA FRN 20/11/2028	219,874	0.00
EUR	400,000 E-Carat SA FRN 20/11/2028	439,334	0.00
EUR	2,200,000 European TopSoho Sarl 4% 21/9/2021	1,685,614	0.02
EUR	260,000 Garfunkelux Holdco 3 SA FRN 1/9/2023	278,002	0.00
EUR	1,550,000 Garfunkelux Holdco 3 SA 7.5% 1/8/2022*	1,700,094	0.02
GBP	200,000 Garfunkelux Holdco 3 SA 8.5% 1/11/2022*	255,468	0.00
USD	201,000 Gillex Holding Sarl '144A' 8.5% 2/5/2023	214,603	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ(続き)			
USD	2,520,000 GoI Finance SA ' 144A ' 7% 31/1/2025	2,408,963	0.02
EUR	200,000 Hanesbrands Finance Luxembourg SCA 3.5% 15/6/2024	237,592	0.00
EUR	1,175,000 Holcim Finance Luxembourg SA FRN 5/7/2024 (Perpetual)	1,348,055	0.01
USD	2,855,000 Intelsat Jackson Holdings SA 5.5% 1/8/2023	2,490,516	0.02
USD	3,203,000 Intelsat Jackson Holdings SA ' 144A ' 8.5% 15/10/2024	2,847,339	0.03
USD	2,309,000 Intelsat SA 4.5% 15/6/2025	1,015,960	0.01
USD	425,000 JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc ' 144A ' 5.5% 15/1/2030	453,411	0.01
USD	2,207,000 JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc ' 144A ' 6.5% 15/4/2029	2,421,256	0.02
USD	3,997,000 Kenbourne Invest SA ' 144A ' 6.875% 26/11/2024	4,201,846	0.04
USD	2,799,000 Klabin Finance SA ' 144A ' 4.875% 19/9/2027	2,956,444	0.03
EUR	3,160,000 LHMC Finco 2 Sarl 7.25% 2/10/2025*	3,504,173	0.03
EUR	900,000 Matterhorn Telecom SA 4% 15/11/2027	1,031,059	0.01
EUR	880,000 Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 7/3/2027	1,022,912	0.01
EUR	1,310,000 Medtronic Global Holdings SCA 1.625% 7/3/2031*	1,601,839	0.02
EUR	3,100,000 Medtronic Global Holdings SCA 1.75% 2/7/2049	3,484,604	0.03
EUR	1,100,000 Medtronic Global Holdings SCA 2.25% 7/3/2039	1,413,775	0.01
USD	1,016,000 MHP Lux SA ' 144A ' 6.25% 19/9/2029	1,021,080	0.01
USD	270,000 Millicom International Cellular SA 5.125% 15/1/2028	281,138	0.00
USD	388,000 Millicom International Cellular SA ' 144A ' 5.125% 15/1/2028	404,005	0.00
USD	1,800,000 Millicom International Cellular SA ' 144A ' 6.625% 15/10/2026	1,932,750	0.02
USD	633,000 Minerva Luxembourg SA ' 144A ' 6.5% 20/9/2026	660,892	0.01
EUR	300,000 Monitchem HoldCo 2 SA 9.5% 15/9/2026	339,478	0.00
EUR	838,000 Monitchem HoldCo 3 SA 5.25% 15/3/2025	944,648	0.01
USD	777,000 Nexa Resources SA ' 144A ' 5.375% 4/5/2027	820,706	0.01
USD	203,000 Nielsen Co Luxembourg SARL/ The ' 144A ' 5% 1/2/2025	202,937	0.00
USD	2,087,000 Puma International Financing SA ' 144A ' 5% 24/1/2026*	1,970,390	0.02
USD	1,158,000 Puma International Financing SA ' 144A ' 5.125% 6/10/2024	1,134,137	0.01
EUR	2,638,000 Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025*	3,141,666	0.03
USD	3,409,000 Rumo Luxembourg Sarl ' 144A ' 5.875% 18/1/2025	3,639,640	0.04
EUR	200,000 SES SA FRN 2/1/2022 (Perpetual)	225,645	0.00
EUR	3,090,000 SES SA FRN 29/1/2024 (Perpetual)	3,711,009	0.04
EUR	1,845,000 SES SA 1.625% 22/3/2026*	2,132,750	0.02
USD	500,000 SES SA ' 144A ' 5.3% 4/4/2043	556,444	0.01
EUR	300,000 Silver Arrow S.A. Compartment 10 FRN 15/3/2027	336,145	0.00
EUR	300,000 Silver Arrow S.A. Compartment 10 FRN 15/3/2027	330,858	0.00
EUR	1,898,947 Summer BC Holdco A Sarl 9.25% 31/10/2027*	2,161,537	0.02
EUR	5,800,000 Summer BC Holdco B SARL 5.75% 31/10/2026	6,621,310	0.06
USD	1,020,000 Telecom Italia Capital SA 6.375% 15/11/2033*	1,202,937	0.01
USD	1,600,000 Telecom Italia Capital SA 7.721% 4/6/2038	2,080,064	0.02
EUR	318,000 Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/1/2033	533,666	0.01
EUR	700,000 TLG Finance Sarl (Restricted) FRN 23/9/2024 (Perpetual)*	811,891	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ(続き)			
USD	817,000 Usiminas International Sarl ' 144A ' 5.875% 18/7/2026	834,361	0.01
EUR	1,525,000 Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.1% 9/11/2027	1,753,448	0.02
EUR	2,240,000 Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.25% 2/11/2026	2,608,812	0.03
EUR	1,188,000 Ypso Finance Bis SA 8% 15/5/2027	1,460,061	0.01
		114,390,162	1.09
マレーシア			
USD	4,600,000 1MDB Energy Ltd 5.99% 11/5/2022	4,807,000	0.05
USD	8,874,000 Cindai Capital Ltd 8/2/2023 (Zero Coupon)	8,955,140	0.08
MYR	20,500,000 Malaysia Government Bond 3.906% 15/7/2026	5,189,437	0.05
MYR	32,200,000 Malaysia Government Bond 4.642% 7/11/2033	8,972,446	0.09
MYR	28,600,000 Malaysia Government Bond 4.893% 8/6/2038	8,295,009	0.08
USD	450,000 TNB Global Ventures Capital Bhd 4.851% 1/11/2028*	531,992	0.00
USD	2,800,000 Top Glove Labuan Ltd 2% 1/3/2024	3,078,823	0.03
		39,829,847	0.38
モルディブ			
USD	2,480,000 Republic of Maldives Ministry of Finance and Treasury Bond 7% 7/6/2022	2,428,540	0.02
モーリシャス			
USD	200,000 Greenko Solar Mauritius Ltd 5.55% 29/1/2025	203,459	0.00
USD	200,000 Network i2i Ltd FRN 15/1/2025 (Perpetual)*	199,625	0.00
		403,084	0.00
メキシコ			
USD	4,123,000 Alpha Holding SA de CV ' 144A ' 9% 10/2/2025	4,102,385	0.04
USD	459,000 Axtel SAB de CV ' 144A ' 6.375% 14/11/2024	482,983	0.00
USD	272,000 Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman ' 144A ' FRN 27/9/2024 (Perpetual)	290,190	0.00
USD	3,844,000 BBVA Bancomer SA/Texas ' 144A ' FRN 13/9/2034	4,264,341	0.04
USD	578,000 BBVA Bancomer SA/Texas ' 144A ' 6.75% 30/9/2022	631,555	0.01
USD	200,000 Braskem Idesa SAPI ' 144A ' 7.45% 15/11/2029	201,000	0.00
EUR	1,125,000 Cemex SAB de CV 3.125% 19/3/2026	1,282,159	0.01
USD	791,000 Cemex SAB de CV 3.72% 15/3/2020	795,010	0.01
USD	460,000 Controladora Mabe SA de CV ' 144A ' 5.6% 23/10/2028	522,963	0.01
USD	222,000 Credito Real SAB de CV SOFOM ER ' 144A ' 7.25% 20/7/2023	232,476	0.00
USD	622,000 Cydsa SAB de CV ' 144A ' 6.25% 4/10/2027	636,578	0.01
USD	470,000 Fomento Economico Mexicano SAB de CV 3.5% 16/1/2050	493,250	0.01
USD	614,000 Grupo Bimbo SAB de CV ' 144A ' FRN 17/4/2023 (Perpetual)	646,296	0.01
USD	474,000 Grupo Bimbo SAB de CV 4.5% 25/1/2022	498,663	0.01
USD	4,364,000 Grupo KUO SAB De CV ' 144A ' 5.75% 7/7/2027	4,475,407	0.04
USD	2,865,000 Industrias Penoles SAB de CV ' 144A ' 4.15% 12/9/2029	3,006,459	0.03
MXN	634,876 Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	3,087,295	0.03
MXN	445,029 Mexican Bonos 8.5% 31/5/2029	2,538,166	0.02
USD	511,000 Mexico City Airport Trust ' 144A ' 4.25% 31/10/2026	553,876	0.01
USD	225,000 Mexico Government International Bond 3.6% 30/1/2025	239,836	0.00
USD	2,955,000 Mexico Government International Bond 3.75% 11/1/2028	3,168,314	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
メキシコ(続き)			
USD	361,000 Mexico Government International Bond 4.125% 21/1/2026	395,633	0.00
USD	436,000 Mexico Government International Bond 4.15% 28/3/2027	480,690	0.00
USD	6,227,000 Mexico Government International Bond 4.5% 22/4/2029	7,049,159	0.07
USD	1,698,000 Minera Mexico SA de CV '144A' 4.5% 26/1/2050	1,755,308	0.02
USD	450,000 Operadora de Servicios Mega SA de CV Sofom ER '144A' 8.25% 11/2/2025	461,925	0.00
USD	376,000 Orbia Advance Corp SAB de CV '144A' 5.5% 15/1/2048	419,299	0.00
USD	1,353,000 Petroleos Mexicanos 4.5% 23/1/2026	1,347,588	0.01
USD	34,000 Petroleos Mexicanos 5.35% 12/2/2028	33,422	0.00
USD	1,626,000 Petroleos Mexicanos '144A' 5.95% 28/1/2031	1,611,382	0.02
USD	6,893,000 Petroleos Mexicanos 6.5% 13/3/2027	7,323,813	0.07
USD	136,000 Petroleos Mexicanos 6.5% 23/1/2029	142,114	0.00
USD	3,988,000 Petroleos Mexicanos 6.625% 15/6/2035	4,041,838	0.04
USD	386,000 Petroleos Mexicanos '144A' 6.84% 23/1/2030	408,002	0.00
USD	7,075,000 Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	7,764,813	0.07
USD	7,882,000 Petroleos Mexicanos '144A' 6.95% 28/1/2060	7,684,950	0.07
USD	1,671,000 Unifin Financiera SAB de CV '144A' FRN 29/1/2025 (Perpetual)	1,646,718	0.02
		74,715,856	0.71
モンゴル			
USD	2,472,000 Mongolian Mortgage Corp Hfc LLC 9.75% 29/1/2022	2,412,153	0.02
オランダ			
EUR	1,700,000 ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2020 (Perpetual)	1,904,147	0.02
GBP	2,300,000 ABN AMRO Bank NV 1.375% 16/1/2025	2,965,767	0.03
USD	211,000 Alcoa Nederland Holding BV '144A' 6.125% 15/5/2028	220,463	0.00
USD	310,000 Alcoa Nederland Holding BV '144A' 6.75% 30/9/2024	321,622	0.00
USD	208,000 Alcoa Nederland Holding BV '144A' 7% 30/9/2026	221,177	0.00
EUR	700,000 ALME Loan Funding V BV FRN 15/7/2031	776,345	0.01
EUR	954,000 Ashland Services BV 2% 30/1/2028	1,012,850	0.01
EUR	600,000 Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/1/2025	667,873	0.01
EUR	1,125,000 BMW Finance NV 24/3/2023 (Zero Coupon)	1,235,168	0.01
EUR	3,950,000 BMW Finance NV 14/4/2023 (Zero Coupon)*	4,331,218	0.04
EUR	600,000 Cairn CLO IX BV FRN 21/3/2032	644,505	0.01
EUR	800,000 Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/12/2025 (Perpetual)	947,732	0.01
GBP	800,000 Daimler International Finance BV 1.625% 11/11/2024	1,027,543	0.01
EUR	4,210,000 Digital Dutch Finco BV 0.625% 15/7/2025*	4,662,878	0.04
EUR	531,000 Dufry One BV 2% 15/2/2027	558,591	0.01
EUR	3,100,000 Ferroviaal Netherlands BV FRN 14/2/2023 (Perpetual)	3,342,302	0.03
EUR	896,000 Hertz Holdings Netherlands BV 5.5% 30/3/2023	1,002,713	0.01
EUR	4,000,000 Iberdrola International BV FRN 12/11/2024 (Perpetual)	4,770,992	0.05
USD	2,654,000 IHS Netherlands Holdco BV '144A' 8% 18/9/2027*	2,891,586	0.03
USD	5,690,000 ING Groep NV FRN 16/4/2024 (Perpetual)	6,110,975	0.06
EUR	1,700,000 ING Groep NV FRN 15/2/2029	1,997,393	0.02
GBP	1,800,000 ING Groep NV 3% 18/2/2026	2,478,210	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
EUR	1,067,000 Intertrust Group BV 3.375% 15/11/2025	1,210,849	0.01
EUR	1,750,000 InterXion Holding NV 4.75% 15/6/2025	2,055,265	0.02
EUR	1,500,000 Koninklijke KPN NV FRN 8/11/2024 (Perpetual)	1,634,632	0.02
EUR	100,000 Magoi 2019 BV FRN 27/7/2039	110,009	0.00
EUR	200,000 Magoi 2019 BV FRN 27/7/2039	219,838	0.00
EUR	100,000 Magoi 2019 BV FRN 27/7/2039	110,131	0.00
USD	7,020,000 MDGH - GMTN BV ' 144A ' 2.5% 7/11/2024	7,156,012	0.07
USD	2,215,000 MDGH - GMTN BV ' 144A ' 2.875% 7/11/2029	2,277,989	0.02
USD	4,625,000 MDGH - GMTN BV 3.7% 7/11/2049	4,942,969	0.05
USD	1,681,000 Mong Duong Finance Holdings BV 5.125% 7/5/2029*	1,745,088	0.02
EUR	1,800,000 Naturgy Finance BV FRN 18/11/2022 (Perpetual)	2,109,930	0.02
EUR	700,000 Naturgy Finance BV FRN 24/4/2024 (Perpetual)*	813,811	0.01
USD	10,173,000 NXP BV / NXP Funding LLC ' 144A ' 4.125% 1/6/2021	10,444,131	0.10
EUR	1,985,000 OCI NV 5% 15/4/2023*	2,232,624	0.02
EUR	1,258,000 OI European Group BV 2.875% 15/2/2025	1,406,930	0.01
USD	182,000 Petrobras Global Finance BV 4.375% 20/5/2023	191,669	0.00
USD	1,516,000 Petrobras Global Finance BV ' 144A ' 5.093% 15/1/2030*	1,637,280	0.02
USD	1,161,000 Petrobras Global Finance BV 5.299% 27/1/2025	1,274,197	0.01
USD	575,000 Petrobras Global Finance BV 5.999% 27/1/2028	656,937	0.01
USD	17,000 Petrobras Global Finance BV 6.125% 17/1/2022	18,119	0.00
USD	741,000 Petrobras Global Finance BV 6.85% 5/6/2115*	881,790	0.01
USD	11,001,000 Petrobras Global Finance BV 7.25% 17/3/2044	13,679,056	0.13
USD	144,000 Petrobras Global Finance BV 7.375% 17/1/2027	176,342	0.00
USD	3,903,000 Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/5/2026	5,017,345	0.05
EUR	752,000 Q-Park Holding I BV FRN 1/3/2026	825,661	0.01
EUR	864,000 Q-Park Holding I BV 1.5% 1/3/2025	949,333	0.01
EUR	447,000 Q-Park Holding I BV 2% 1/3/2027	492,437	0.00
EUR	1,831,000 Repsol International Finance BV FRN 25/3/2021 (Perpetual)*	2,065,939	0.02
USD	2,951,000 SABIC Capital II BV ' 144A ' 4% 10/10/2023	3,125,109	0.03
USD	1,924,000 SABIC Capital II BV 4.5% 10/10/2028*	2,186,446	0.02
EUR	8,900,000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 20/2/2026 (Zero Coupon)	9,753,237	0.09
EUR	6,100,000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.25% 20/2/2029	6,644,226	0.06
EUR	4,800,000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.5% 20/2/2032	5,278,731	0.05
GBP	4,600,000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 1% 20/2/2025	5,883,568	0.06
EUR	100,000 Sudzucker International Finance BV FRN 30/3/2020 (Perpetual)	95,647	0.00
EUR	448,000 Summer BidCo BV 9% 15/11/2025	522,067	0.00
EUR	540,000 Summer BidCo BV 9% 15/11/2025	627,089	0.01
EUR	300,000 Sunshine Mid BV 6.5% 15/5/2026	334,420	0.00
EUR	4,000,000 Telefonica Europe BV FRN 15/3/2022 (Perpetual)*	4,608,603	0.04
EUR	400,000 Telefonica Europe BV FRN 7/3/2023 (Perpetual)	444,196	0.00
EUR	1,800,000 Telefonica Europe BV FRN 31/3/2024 (Perpetual)	2,250,592	0.02
EUR	8,700,000 Telefonica Europe BV FRN 14/12/2024 (Perpetual)*	10,436,544	0.10
EUR	4,000,000 Telefonica Europe BV FRN 22/6/2026 (Perpetual)*	4,762,824	0.05

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
USD	1,863,000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV '144A' 7.125% 31/1/2025	1,969,540	0.02
EUR	1,371,000 Toyota Motor Finance Netherlands BV 0.625% 26/9/2023	1,539,172	0.01
EUR	923,000 Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/8/2026	1,052,816	0.01
EUR	1,167,000 United Group BV FRN 15/2/2026	1,289,548	0.01
EUR	1,483,000 United Group BV 3.625% 15/2/2028	1,602,704	0.01
EUR	1,226,000 United Group BV 4.875% 1/7/2024*	1,398,922	0.01
EUR	4,131,000 United Group BV 4.875% 1/7/2024*	4,691,006	0.04
EUR	3,866,000 UPC Holding BV 3.875% 15/6/2029*	4,324,996	0.04
USD	4,725,000 VEON Holdings BV '144A' 4% 9/4/2025	4,931,719	0.05
GBP	3,000,000 Volkswagen Financial Services NV 1.625% 10/2/2024*	3,834,013	0.04
EUR	1,400,000 Volkswagen International Finance NV FRN 14/12/2022 (Perpetual)	1,556,605	0.01
EUR	500,000 Volkswagen International Finance NV FRN 14/6/2027 (Perpetual)	571,971	0.01
EUR	600,000 Volkswagen International Finance NV FRN 27/6/2028 (Perpetual)	724,204	0.01
EUR	1,100,000 Volkswagen International Finance NV 1.125% 2/10/2023	1,236,088	0.01
EUR	2,800,000 Vonovia Finance BV 1.25% 6/12/2024	3,226,805	0.03
EUR	1,700,000 Vonovia Finance BV 1.8% 29/6/2025	2,008,159	0.02
EUR	2,074,000 VZ Vendor Financing BV 2.5% 31/1/2024	2,289,530	0.02
EUR	6,100,000 ZF Europe Finance BV 2.5% 23/10/2027*	6,819,982	0.06
EUR	2,553,000 Ziggo Bond Co BV 3.375% 28/2/2030	2,750,825	0.03
EUR	351,000 Ziggo BV 2.875% 15/1/2030	388,610	0.00
EUR	1,800,000 Ziggo BV 4.25% 15/1/2027	2,080,317	0.02
USD	7,537,000 Ziggo BV '144A' 5.5% 15/1/2027	7,918,372	0.08
		225,587,566	2.14
ナイジェリア			
NGN	401,706,000 Nigeria Government International Bond 28/5/2020 (Zero Coupon)	1,091,338	0.01
NGN	200,855,000 Nigeria Government International Bond 30/7/2020 (Zero Coupon)	542,564	0.01
USD	467,000 Nigeria Government International Bond 6.375% 12/7/2023	498,085	0.00
USD	1,635,000 Nigeria Government International Bond 7.625% 21/11/2025	1,795,434	0.02
		3,927,421	0.04
ノルウェー			
USD	400,000 DNB Bank ASA FRN 26/3/2020 (Perpetual)	400,506	0.00
EUR	368,000 Explorer II AS 3.375% 24/2/2025	410,301	0.00
EUR	2,300,000 Telenor ASA 25/9/2023 (Zero Coupon)	2,531,838	0.03
		3,342,645	0.03
パナマ			
USD	795,000 AES Panama SRL '144A' 6% 25/6/2022	814,765	0.01
USD	499,000 Avianca Holdings SA '144A' 9% 10/5/2023	474,050	0.00
USD	533,000 Avianca Holdings SA '144A' 9% 10/5/2023	481,033	0.01
USD	274,000 Banistmo SA 3.65% 19/9/2022	279,994	0.00
USD	200,000 Cable Onda SA '144A' 4.5% 30/1/2030	205,750	0.00
USD	361,000 Cable Onda SA 4.5% 30/1/2030	371,379	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
パナマ(続き)			
USD	648,000 Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	721,406	0.01
USD	704,000 Panama Government International Bond 4% 22/9/2024	762,850	0.01
		4,111,227	0.04
パラグアイ			
USD	1,256,000 Paraguay Government International Bond ' 144A ' 5.4% 30/3/2050	1,517,876	0.01
ペルー			
USD	2,571,000 Banco Internacional del Peru SAA Interbank ' 144A ' 3.25% 4/10/2026	2,630,053	0.03
USD	993,000 Orazul Energy Egenor SCA ' 144A ' 5.625% 28/4/2027	1,033,340	0.01
PEN	11,518,000 Peru Government Bond ' 144A ' 5.35% 12/8/2040	3,522,262	0.03
USD	5,844,000 Peruvian Government International Bond 4.125% 25/8/2027	6,674,944	0.06
PEN	6,500,000 Telefonica del Peru SAA ' 144A ' 7.375% 10/4/2027	2,021,858	0.02
		15,882,457	0.15
フィリピン			
USD	3,322,000 Philippine Government International Bond 3.75% 14/1/2029	3,790,713	0.03
USD	906,000 Philippine Government International Bond 4.2% 21/1/2024	987,682	0.01
USD	697,000 Philippine Government International Bond 5.5% 30/3/2026	837,598	0.01
		5,615,993	0.05
ポーランド			
USD	465,000 Republic of Poland Government International Bond 3% 17/3/2023	485,416	0.00
USD	486,000 Republic of Poland Government International Bond 3.25% 6/4/2026	526,323	0.01
		1,011,739	0.01
ポルトガル			
EUR	200,000 Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 2.625% 8/5/2017	42,774	0.00
EUR	20,500,000 Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 4% 21/1/2019	4,384,377	0.04
EUR	2,000,000 Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 4.75% 15/1/2018	427,744	0.00
EUR	400,000 EDP - Energias de Portugal SA FRN 30/4/2079	483,680	0.00
EUR	900,000 SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	1,035,359	0.01
EUR	500,000 SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	547,348	0.01
EUR	3,499,662 TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta IV 2.423% 12/2/2021	3,886,987	0.04
EUR	7,259,773 TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta VII 0.7% 12/2/2024	7,986,192	0.08
EUR	9,434,255 TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta V 0.85% 12/2/2022	10,451,901	0.10
EUR	2,000,000 Transportes Aereos Portugueses SA ' 144A ' 5.625% 2/12/2024*	2,221,023	0.02
		31,467,385	0.30
カタール			
USD	2,047,000 Qatar Government International Bond ' 144A ' 4% 14/3/2029	2,323,025	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
カタール(続き)			
USD	4,447,000 Qatar Government International Bond 4.5% 23/4/2028	5,155,741	0.05
		7,478,766	0.07
ロシア連邦			
RUB	1,378,381,000 Russian Federal Bond - OFZ 6.9% 23/5/2029	21,389,963	0.20
RUB	863,170,000 Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/1/2028	13,481,601	0.13
RUB	1,529,068,000 Russian Federal Bond - OFZ 7.1% 16/10/2024	23,802,991	0.23
RUB	2,552,469,000 Russian Federal Bond - OFZ 8.5% 17/9/2031	44,195,381	0.42
USD	2,000,000 Russian Foreign Bond - Eurobond 4.25% 23/6/2027	2,212,500	0.02
USD	17,800,000 Russian Foreign Bond - Eurobond 4.375% 21/3/2029	19,847,000	0.19
ロシア連邦(続き)			
USD	2,000,000 Russian Foreign Bond - Eurobond 4.75% 27/5/2026	2,254,062	0.02
		127,183,498	1.21
サウジアラビア			
USD	442,000 Saudi Arabian Oil Co 3.5% 16/4/2029	469,556	0.00
USD	420,000 Saudi Arabian Oil Co '144A' 3.5% 16/4/2029	446,184	0.00
USD	4,930,000 Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026	5,194,988	0.05
USD	509,000 Saudi Government International Bond 4% 17/4/2025	552,265	0.01
USD	809,000 Saudi Government International Bond '144A' 4.375% 16/4/2029	922,766	0.01
USD	7,092,000 Saudi Government International Bond 4.375% 16/4/2029	8,089,312	0.08
USD	1,376,000 Saudi Government International Bond 4.5% 17/4/2030	1,596,160	0.02
USD	1,918,000 Saudi Government International Bond 5.25% 16/1/2050	2,468,019	0.02
USD	2,373,000 Saudi Telecom Co '144A' 3.89% 13/5/2029	2,582,299	0.02
		22,321,549	0.21
シンガポール			
USD	200,000 ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/7/2024	209,040	0.00
USD	4,800,000 BOC Aviation Ltd 3% 11/9/2029	4,875,000	0.05
USD	1,301,000 Global Prime Capital Pte Ltd 7.25% 26/4/2021	1,336,862	0.01
USD	1,922,600 LLPL Capital Pte Ltd 6.875% 4/2/2039	2,266,664	0.02
USD	200,000 Medco Platinum Road Pte Ltd 6.75% 30/1/2025	196,444	0.00
		8,884,010	0.08
南アフリカ			
ZAR	71,435,400 Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	4,258,490	0.04
ZAR	55,690,264 Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	3,215,490	0.03
USD	4,309,000 Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 27/9/2027*	4,515,697	0.04
USD	840,000 Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 30/5/2022	900,900	0.01
		12,890,577	0.12
韓国			
USD	3,082,000 Heungkuk Life Insurance Co Ltd FRN 9/11/2022 (Perpetual)	3,108,763	0.03
USD	2,820,000 KDB Life Insurance Co Ltd FRN 21/5/2023 (Perpetual)	2,862,300	0.03
USD	4,600,000 Kookmin Bank FRN 2/7/2024 (Perpetual)*	4,753,813	0.04
EUR	1,100,000 LG Chem Ltd 16/4/2021 (Zero Coupon)	1,221,287	0.01
USD	200,000 LG Display Co Ltd 1.5% 22/8/2024	210,594	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
韓国(続き)			
USD	2,900,000 Shinhan Financial Group Co Ltd FRN 13/8/2023 (Perpetual)*	3,138,344	0.03
USD	2,625,000 Shinhan Financial Group Co Ltd FRN 5/2/2030	2,738,203	0.03
USD	200,000 Woori Bank FRN 4/10/2024 (Perpetual)	202,250	0.00
		18,235,554	0.17
スペイン			
EUR	4,600,000 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 14/4/2021 (Perpetual)*	5,449,912	0.05
USD	200,000 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 16/11/2027 (Perpetual)	204,913	0.00
EUR	3,000,000 Banco de Sabadell SA FRN 18/5/2022 (Perpetual)	3,405,501	0.03
EUR	2,100,000 Banco de Sabadell SA (Restricted) FRN 17/1/2030	2,257,841	0.02
EUR	1,000,000 Banco Santander SA FRN 25/4/2022 (Perpetual)	1,185,114	0.01
EUR	1,000,000 Banco Santander SA FRN 14/1/2026 (Perpetual)	1,075,107	0.01
EUR	2,400,000 Bankia SA FRN 18/7/2022 (Perpetual)*	2,722,427	0.03
EUR	4,800,000 Bankia SA FRN 19/9/2023 (Perpetual)*	5,709,028	0.06
EUR	400,000 Bilbao CLO I DAC FRN 20/7/2031	428,336	0.01
EUR	1,100,000 Bilbao CLO I DAC FRN 20/7/2031	1,199,872	0.01
EUR	7,600,000 CaixaBank SA FRN 13/6/2024 (Perpetual)*	9,271,189	0.09
EUR	1,800,000 CaixaBank SA FRN 23/3/2026 (Perpetual)	2,030,962	0.02
EUR	500,000 Distribuidora Internacional de Alimentacion SA 0.875% 6/4/2023*	303,654	0.00
EUR	1,000,000 Distribuidora Internacional de Alimentacion SA 1% 28/4/2021	955,975	0.01
EUR	1,002,000 El Corte Ingles SA 3% 15/3/2024*	1,128,283	0.01
EUR	3,000,000 Hipercor SA 3.875% 19/1/2022*	3,501,283	0.03
EUR	188,833 NH Hotel Group SA 3.75% 1/10/2023	209,088	0.00
EUR	36,940,000 Spain Government Bond '144A' 0.5% 30/4/2030	41,582,614	0.40
EUR	24,640,000 Spain Government Bond '144A' 1% 31/10/2050	26,623,336	0.25
EUR	24,075,000 Spain Government Bond '144A' 2.7% 31/10/2048	37,084,396	0.35
GBP	1,575,000 Telefonica Emisiones SA 5.375% 2/2/2026	2,449,386	0.02
		148,778,217	1.41
スリランカ			
USD	1,102,000 Sri Lanka Government International Bond 6.125% 3/6/2025	1,062,893	0.01
USD	300,000 Sri Lanka Government International Bond 6.35% 28/6/2024	299,014	0.00
USD	1,475,000 Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/3/2024	1,510,322	0.02
USD	726,000 Sri Lanka Government International Bond 6.85% 3/11/2025	720,680	0.01
USD	3,425,000 Sri Lanka Government International Bond 7.55% 28/3/2030	3,302,871	0.03
USD	1,021,000 Sri Lanka Government International Bond 7.85% 14/3/2029	991,690	0.01
		7,887,470	0.08
スウェーデン			
EUR	450,000 Heimstaden Bostad AB FRN 19/11/2024 (Perpetual)*	495,935	0.01
EUR	317,000 Intrum AB 2.75% 15/7/2022	348,447	0.00
EUR	752,000 Intrum AB 3.5% 15/7/2026	801,664	0.01
EUR	1,946,000 Verisure Holding AB 3.5% 15/5/2023	2,171,684	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スウェーデン (続き)			
EUR	1,217,000 Verisure Midholding AB 5.75% 1/12/2023	1,367,123	0.01
EUR	4,540,000 Volvo Treasury AB 11/2/2023 (Zero Coupon)	4,995,239	0.05
		10,180,092	0.10
スイス			
USD	3,425,000 Credit Suisse Group AG FRN 29/7/2022 (Perpetual)	3,671,480	0.04
USD	550,000 Credit Suisse Group AG ' 144A ' FRN 17/7/2023 (Perpetual)	598,975	0.01
USD	700,000 Credit Suisse Group AG ' 144A ' FRN 11/12/2023 (Perpetual)	782,047	0.01
USD	200,000 Credit Suisse Group AG FRN 11/12/2023 (Perpetual)	223,442	0.00
USD	400,000 Credit Suisse Group AG FRN 18/12/2024 (Perpetual)	434,750	0.00
USD	2,383,000 Credit Suisse Group AG ' 144A ' FRN 18/12/2024 (Perpetual)*	2,590,023	0.02
EUR	1,795,000 Credit Suisse Group AG FRN 17/7/2025	2,032,060	0.02
USD	4,396,000 Credit Suisse Group AG ' 144A ' FRN 11/9/2025	4,487,977	0.04
USD	1,300,000 Credit Suisse Group AG ' 144A ' FRN 12/9/2025 (Perpetual)	1,453,653	0.01
GBP	2,185,000 Credit Suisse Group AG FRN 12/9/2025	2,874,603	0.03
USD	2,905,000 Credit Suisse Group AG ' 144A ' FRN 21/8/2026 (Perpetual)*	3,139,826	0.03
USD	1,453,000 Credit Suisse Group AG ' 144A ' FRN 24/1/2030 (Perpetual)	1,458,449	0.01
EUR	800,000 UBS Group AG FRN 19/2/2022 (Perpetual)	943,230	0.01
USD	11,326,000 UBS Group AG ' 144A ' FRN 31/1/2024 (Perpetual)*	12,211,637	0.12
EUR	1,495,000 UBS Group AG FRN 29/1/2026	1,657,148	0.02
		38,559,300	0.37
台湾			
USD	2,400,000 Hon Hai Precision Industry Co Ltd 6/11/2022 (Zero Coupon)	2,389,663	0.02
USD	2,600,000 Innolux Corp 22/1/2025 (Zero Coupon)	2,527,426	0.03
		4,917,089	0.05
タイ			
USD	5,125,000 Bangkok Bank PCL/Hong Kong FRN 25/9/2034	5,317,188	0.05
USD	4,300,000 Kasikornbank PCL/Hong Kong FRN 2/10/2031	4,412,203	0.04
USD	2,900,000 Singha Estate PCL 2% 20/7/2022	2,855,933	0.03
		12,585,324	0.12
トルコ			
USD	659,000 Turkey Government International Bond 4.875% 16/4/2043	536,879	0.00
USD	6,154,000 Turkey Government International Bond 5.125% 17/2/2028	5,802,068	0.06
USD	7,496,000 Turkey Government International Bond 7.625% 26/4/2029	8,079,282	0.08
USD	1,480,280 Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust ' 144A ' 4.2% 15/3/2027	1,414,070	0.01
		15,832,299	0.15
ウクライナ			
EUR	3,100,000 Ukraine Government International Bond 6.75% 20/6/2026	3,833,520	0.04
USD	123,000 Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2022	132,686	0.00
USD	235,000 Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2023	254,975	0.00
USD	795,000 Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2025	869,138	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ウクライナ(続き)			
USD	471,000 Ukraine Government International Bond 8.994% 1/2/2024*	529,286	0.00
USD	15,547,000 Ukraine Government International Bond 9.75% 1/11/2028*	18,780,290	0.18
		24,399,895	0.23
アラブ首長国連邦			
USD	3,000,000 Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC 4.6% 2/11/2047	3,532,500	0.03
USD	2,965,000 Abu Dhabi Government International Bond ' 144A ' 2.125% 30/9/2024*	3,007,622	0.03
USD	4,850,000 Abu Dhabi Government International Bond 3.125% 30/9/2049	4,956,094	0.05
USD	5,100,000 Emirates NBD Bank PJSC FRN 20/3/2025 (Perpetual)	5,430,703	0.05
		16,926,919	0.16
英国			
EUR	174,000 Arrow Global Finance Plc FRN 1/3/2026	192,282	0.00
GBP	2,251,000 Arrow Global Finance Plc 5.125% 15/9/2024*	2,936,566	0.03
USD	1,660,000 Barclays Plc FRN 15/3/2022 (Perpetual)	1,767,900	0.02
USD	1,800,000 Barclays Plc FRN 15/6/2024 (Perpetual)*	2,003,751	0.02
GBP	1,000,000 Barclays Plc FRN 15/9/2024 (Perpetual)	1,298,008	0.01
GBP	9,180,000 Barclays Plc FRN 15/6/2025 (Perpetual)	13,007,229	0.12
EUR	4,167,000 Barclays Plc FRN 11/11/2025	4,622,474	0.04
EUR	900,000 Barclays Plc FRN 7/2/2028	1,001,641	0.01
EUR	3,885,000 Barclays Plc 1.875% 8/12/2023	4,498,299	0.04
EUR	1,655,000 British Telecommunications Plc 0.875% 26/9/2023*	1,865,060	0.02
GBP	1,000,000 Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	1,131,276	0.01
GBP	4,392,000 Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	4,914,797	0.05
EUR	2,625,000 Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	3,120,340	0.03
GBP	1,850,000 Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	2,558,311	0.02
EUR	3,925,000 Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050*	4,380,927	0.04
GBP	220,000 CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	282,106	0.00
GBP	105,000 CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	131,130	0.00
EUR	500,000 CVC Cordatus Loan Fund XV DAC FRN 26/8/2032	541,418	0.01
GBP	1,350,250 Dignity Finance Plc 3.546% 31/12/2034	1,912,879	0.02
GBP	350,000 Dignity Finance Plc 4.696% 31/12/2049	398,310	0.00
EUR	3,679,000 eG Global Finance Plc 3.625% 7/2/2024*	3,878,694	0.04
EUR	1,763,000 eG Global Finance Plc 4.375% 7/2/2025	1,836,941	0.02
EUR	6,389,000 eG Global Finance Plc 6.25% 30/10/2025*	7,038,536	0.07
GBP	7,750,000 EI Group Plc 6% 6/10/2023	10,032,831	0.10
GBP	425,000 EI Group Plc 6.375% 15/2/2022	551,730	0.01
GBP	390,000 EI Group Plc 6.875% 15/2/2021	506,418	0.00
GBP	413,999 EnQuest Plc 7% 15/4/2022*	468,552	0.00
USD	2,111,730 EnQuest Plc ' 144A ' 7% 15/4/2022*	1,800,236	0.02
USD	1,606,000 Evraz Plc ' 144A ' 5.25% 2/4/2024	1,734,229	0.02
GBP	949,979 Finsbury Square 2017-1 Plc ' Series 2017-1 C ' FRN 12/3/2059	1,219,635	0.01
GBP	887,981 Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,133,211	0.01
GBP	1,297,972 Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,657,247	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP	1,385,970 Finsbury Square 2018-1 Plc ' Series 2018-1 B ' FRN 12/9/2065	1,772,276	0.02
GBP	950,000 Finsbury Square 2018-2 Plc FRN 12/9/2068	1,226,878	0.01
GBP	5,981,000 Finsbury Square 2018-2 Plc FRN 12/9/2068	7,701,720	0.07
GBP	235,000 Finsbury Square 2019-2 Plc FRN 16/9/2069	307,631	0.00
GBP	215,000 Finsbury Square 2019-2 Plc FRN 16/9/2069	279,098	0.00
GBP	215,000 Finsbury Square 2020-1 Plc FRN 16/3/2070	276,287	0.00
GBP	884,793 Gemgarto 2018-1 Plc FRN 1 6/9/2065	1,112,338	0.01
GBP	305,928 Gemgarto 2018-1 Plc FRN 16/9/2065	383,211	0.00
GBP	1,880,000 Great Hall Mortgages No 1 Plc ' Series 2007-2X BA ' FRN 18/6/2039	2,239,129	0.02
GBP	9,387,588 Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	12,081,974	0.11
GBP	300,000 Greene King Finance Plc FRN 15/3/2036	353,185	0.00
GBP	2,875,000 Greene King Finance Plc 3.593% 15/3/2035	4,137,357	0.04
GBP	1,227,179 Greene King Finance Plc 4.064% 15/3/2035	1,792,102	0.02
GBP	300,000 Greene King Finance Plc 5.702% 15/12/2034	358,667	0.00
GBP	814,000 Heathrow Finance Plc 4.125% 1/9/2029	1,050,352	0.01
GBP	200,000 Heathrow Finance Plc 4.75% 1/3/2024	271,646	0.00
GBP	2,100,000 Iceland Bondco Plc 4.625% 15/3/2025	2,158,950	0.02
EUR	800,000 International Game Technology Plc 4.75% 15/2/2023	928,613	0.01
USD	3,954,000 International Game Technology Plc ' 144A ' 6.25% 15/2/2022	4,089,543	0.04
USD	601,000 International Game Technology Plc ' 144A ' 6.25% 15/1/2027	666,719	0.01
USD	2,133,000 International Game Technology Plc ' 144A ' 6.5% 15/2/2025	2,330,324	0.02
GBP	200,000 Intu Metrocentre Finance Plc 4.125% 6/12/2023	233,170	0.00
GBP	700,000 Intu SGS Finance Plc 3.875% 17/3/2023	814,014	0.01
GBP	890,000 Iron Mountain UK Plc 3.875% 15/11/2025	1,163,730	0.01
USD	2,300,000 Ithaca Energy North Sea Plc ' 144A ' 9.375% 15/7/2024	2,386,227	0.02
USD	2,600,000 Jaguar Land Rover Automotive Plc ' 144A ' 4.5% 1/10/2027*	2,216,039	0.02
EUR	1,854,750 Kensington Mortgage Securities Plc ' Series 2007-1X A3B ' FRN 14/6/2040	2,015,228	0.02
GBP	200,000 Ladbrokes Group Finance Plc 5.125% 16/9/2022	272,091	0.00
GBP	350,000 Ladbrokes Group Finance Plc 5.125% 8/9/2023	485,825	0.00
USD	300,000 Lloyds Banking Group Plc ' 144A ' FRN 1/10/2035 (Perpetual)*	360,655	0.00
USD	513,000 Lloyds Banking Group Plc ' 144A ' FRN 21/5/2037 (Perpetual)	638,523	0.01
USD	87,000 Lloyds Banking Group Plc FRN 21/5/2037 (Perpetual)	108,288	0.00
USD	444,000 MARB BondCo Plc ' 144A ' 6.875% 19/1/2025	460,477	0.00
USD	653,000 MARB BondCo Plc 7% 15/3/2024	670,794	0.01
GBP	950,000 Marks & Spencer Plc 3.25% 10/7/2027	1,235,441	0.01
GBP	1,555,000 Mitchells & Butlers Finance Plc FRN 15/6/2036	1,640,046	0.02
EUR	3,290,000 Motability Operations Group Plc 0.375% 3/1/2026	3,655,748	0.03
GBP	1,145,000 Motability Operations Group Plc 4.375% 8/2/2027	1,779,854	0.02
GBP	2,137,000 Motor 2016-1 Plc 3.75% 25/11/2025	2,772,857	0.03
GBP	426,000 Motor 2016-1 Plc 4.25% 25/11/2025	549,122	0.01
GBP	355,000 Motor 2016-1 Plc 5.25% 25/11/2025	454,412	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 3,026,000	National Grid Electricity Transmission Plc 1.375% 16/9/2026	3,925,406	0.04
USD 2,100,000	National Westminster Bank Plc FRN 28/5/2020 (Perpetual)	1,916,775	0.02
USD 10,000	National Westminster Bank Plc FRN 11/7/2020 (Perpetual)	9,025	0.00
USD 100,000	National Westminster Bank Plc FRN 14/8/2020 (Perpetual)	90,250	0.00
USD 2,800,000	Neptune Energy Bondco Plc ' 144A ' 6.625% 15/5/2025	2,656,472	0.03
GBP 2,200,000	Newday Funding 2017-1 Plc ' Series 2017-1 C ' FRN 15/7/2025	2,826,959	0.03
GBP 1,750,000	Newday Funding 2017-1 Plc ' Series 2017-1 D ' FRN 15/7/2025	2,248,719	0.02
EUR 1,047,887	Newgate Funding Plc ' Series 2006-1 BB ' FRN 1/12/2050	1,076,019	0.01
EUR 300,000	Nomad Foods Bondco Plc 3.25% 15/5/2024	333,950	0.00
EUR 94,912	Paragon Mortgages No 10 Plc FRN 15/6/2041	98,352	0.00
EUR 341,690	Paragon Mortgages No 11 Plc FRN 15/10/2041	359,702	0.00
EUR 413,304	Paragon Mortgages No 12 Plc FRN 15/11/2038	419,588	0.00
EUR 1,067,049	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	1,099,842	0.01
EUR 2,795,000	Paragon Mortgages No 14 Plc FRN 15/9/2039	2,661,401	0.03
GBP 2,635,000	Paragon Mortgages No 25 Plc FRN 15/5/2050	3,324,968	0.03
GBP 2,100,000	Paragon Mortgages No 25 Plc FRN 15/5/2050	2,674,384	0.03
GBP 282,000	PCL Funding II Plc ' Series 2017-1 B ' FRN 15/6/2022	362,621	0.00
GBP 179,000	PCL Funding II Plc ' Series 2017-1 C ' FRN 15/6/2022	230,289	0.00
GBP 1,062,000	PCL Funding III Plc FRN 15/6/2023	1,368,226	0.01
GBP 470,000	PCL Funding III Plc ' Series 2017-2 C ' FRN 15/6/2023	607,178	0.01
GBP 638,000	Pinewood Finance Co Ltd 3.25% 30/9/2025	828,649	0.01
GBP 1,734,000	Pinnacle Bidco Plc 6.375% 15/2/2025*	2,285,299	0.02
GBP 700,000	Pizzaexpress Financing 2 Plc 6.625% 1/8/2021	799,017	0.01
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	128,792	0.00
GBP 115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	147,927	0.00
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	128,627	0.00
GBP 1,300,000	Premier Foods Finance Plc 6.25% 15/10/2023*	1,726,810	0.02
GBP 2,981,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	3,854,456	0.04
GBP 799,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	1,032,133	0.01
GBP 180,000	Residential Mortgage Securities 30 Plc FRN 20/3/2050	232,238	0.00
GBP 1,070,000	Residential Mortgage Securities 31 Plc FRN 20/9/2065	1,384,915	0.01
GBP 1,480,000	Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	1,897,909	0.02
GBP 11,250,000	Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	14,405,047	0.14
GBP 420,000	RMAC NO 2 Plc ' Series 2018-2 C ' FRN 12/6/2046	542,633	0.01
EUR 58,923	RMAC Securities No 1 Plc ' Series 2006-NS1X M1C ' FRN 12/6/2044	59,961	0.00
EUR 863,550	RMAC Securities No 1 Plc ' Series 2007-NS1X M1C ' FRN 12/6/2044	889,911	0.01
EUR 1,100,000	Rolls-Royce Plc 0.875% 9/5/2024	1,224,051	0.01
EUR 2,185,000	Royal Bank of Scotland Group Plc 2.5% 22/3/2023	2,555,165	0.02
GBP 2,969,516	Scorpio European Loan Conduit No. 34 DAC ' 144A ' FRN 17/5/2029	3,794,715	0.04
GBP 475,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2028	646,972	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP	4,567,000 Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2031	5,806,933	0.06
GBP	209,000 Stanlington No 1 Plc ' Series 2017-1 E ' FRN 12/6/2046	275,537	0.00
GBP	826,000 Stonegate Pub Co Financing Plc FRN 15/3/2022	1,059,656	0.01
EUR	283,000 Synlab Unsecured Bondco Plc 8.25% 1/7/2023	325,719	0.00
EUR	453,257 Taurus 2019-1 FR DAC FRN 2/2/2031	501,341	0.00
GBP	500,000 Tesco Plc 5% 24/3/2023	706,525	0.01
EUR	200,000 Tesco Plc 5.125% 10/4/2047	326,141	0.00
GBP	900,573 Tesco Property Finance 1 Plc 7.623% 13/7/2039	1,723,369	0.02
GBP	2,142,312 Tesco Property Finance 3 Plc 5.744% 13/4/2040	3,671,051	0.03
GBP	971,756 Tesco Property Finance 4 Plc 5.801% 13/10/2040	1,684,413	0.02
GBP	360,000 Trinity Square 2015-1 Plc ' Series 2015-1X B ' FRN 15/7/2051	463,827	0.00
USD	600,000 Tullow Oil Plc 6.25% 15/4/2022*	448,857	0.00
GBP	1,270,000 Turbo Finance 8 Plc FRN 20/2/2026	1,619,272	0.02
GBP	488,000 Twin Bridges 2018-1 Plc ' Series 2018-1 D ' FRN 12/9/2050	626,304	0.01
GBP	545,000 Twin Bridges 2019-1 Plc FRN 12/12/2052	703,885	0.01
GBP	2,594,156 Unique Pub Finance Co Plc/ The 5.659% 30/6/2027	3,825,227	0.04
GBP	2,297,000 Unique Pub Finance Co Plc/ The 6.464% 30/3/2032	3,797,694	0.04
GBP	1,084,000 Unique Pub Finance Co Plc/ The 7.395% 28/3/2024	1,588,436	0.02
USD	1,414,000 Vedanta Resources Finance II Plc 8% 23/4/2023*	1,330,927	0.01
USD	1,811,000 Vedanta Resources Ltd 6.125% 9/8/2024	1,511,053	0.01
GBP	432,000 Virgin Media Secured Finance Plc 4.875% 15/1/2027*	569,813	0.01
GBP	400,000 Virgin Media Secured Finance Plc 5% 15/4/2027	537,294	0.01
USD	310,000 Virgin Media Secured Finance Plc ' 144A ' 5.5% 15/8/2026	320,665	0.00
GBP	1,938,600 Virgin Media Secured Finance Plc 6.25% 28/3/2029	2,628,605	0.02
USD	600,000 Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078*	652,575	0.01
EUR	500,000 Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078*	612,826	0.01
GBP	150,000 Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078	206,531	0.00
EUR	3,900,000 Vodafone Group Plc FRN 3/1/2079	4,409,464	0.04
USD	1,775,000 Vodafone Group Plc FRN 4/4/2079	2,072,092	0.02
GBP	4,389,488 Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc FRN 21/9/2049	5,643,601	0.05
GBP	6,200,000 Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc FRN 21/9/2049	7,970,237	0.08
GBP	3,700,000 Warwick Finance Residential Mortgages No Two Plc FRN 21/9/2049	4,760,610	0.05
GBP	400,000 William Hill Plc 4.75% 1/5/2026*	534,332	0.00
GBP	200,000 William Hill Plc 4.875% 7/9/2023	272,135	0.00
		283,895,805	2.70
米国			
USD	460,000 1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 ' Series 2015-1211 D ' ' 144A ' FRN 10/8/2035	496,841	0.00
USD	1,500,000 1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 ' Series 2015-1211 E ' ' 144A ' FRN 10/8/2035	1,584,583	0.02
USD	6,150,000 225 Liberty Street Trust 2016- 225L ' Series 2016-225L E ' ' 144A ' FRN 10/2/2036	6,654,612	0.06
USD	320,000 245 Park Avenue Trust 2017- 245P ' Series 2017-245P D ' ' 144A ' FRN 5/6/2037	342,649	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,412,000	245 Park Avenue Trust 2017- 245P ' Series 2017-245P E ' ' 144A ' FRN 5/6/2037	1,452,629	0.01
USD 7,000,000	245 Park Avenue Trust 2017- 245P ' Series 2017-245P XA ' ' 144A ' FRN 5/6/2037	91,980	0.00
USD 2,040,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust ' Series 2017-280P D ' ' 144A ' FRN 15/9/2034	2,049,891	0.02
USD 5,105,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust ' Series 2017-280P E ' ' 144A ' FRN 15/9/2034	5,119,839	0.05
EUR 3,745,000	AbbVie Inc 1.375% 17/5/2024	4,276,023	0.04
USD 4,440,000	Accredited Mortgage Loan Trust 2006-1 ' Series 2006-1 M2 ' FRN 25/4/2036	2,413,805	0.02
USD 1,228,685	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series ' ' 2003-MH1 B2 ' ' 144A ' 15/8/2030 (Zero Coupon)	976,043	0.01
USD 2,264,490	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 ' Series 2007-HE4 A2A ' FRN 25/5/2037	596,027	0.01
USD 1,687,335	ACIS CLO 2014-4 Ltd ' Series 2014-4A A ' ' 144A ' FRN 1/5/2026	1,687,691	0.02
USD 1,435,453	Adams Mill CLO Ltd ' Series 2014-1A A2R ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	1,437,001	0.01
USD 6,075,000	Advanced Micro Devices Inc 7.5% 15/8/2022	6,762,338	0.06
USD 250,000	AIMCO CLO Series 2015-A ' Series 2015-AA BR ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	249,960	0.00
USD 250,000	AIMCO CLO Series 2017-A ' Series 2017-AA A ' ' 144A ' FRN 20/7/2029	251,498	0.00
USD 8,450,239	Ajax Mortgage Loan Trust 2017- D ' Series 2017-D A ' ' 144A ' FRN 25/12/2057	8,781,964	0.08
USD 1,686,480	Ajax Mortgage Loan Trust 2017- D ' Series 2017-D B ' ' 144A ' FRN 25/12/2057	763,807	0.01
USD 2,560,193	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-A ' Series 2018-A B ' ' 144A ' FRN 25/4/2058	1,505,393	0.01
USD 6,414,247	Ajax Mortgage Loan Trust 2018- A ' Series 2018-A A ' ' 144A ' 3.85% 25/4/2058	6,609,870	0.06
USD 1,015,432	Ajax Mortgage Loan Trust 2018- B ' Series 2018-B B ' ' 144A ' 26/2/2057 (Zero Coupon)	286,149	0.00
USD 3,643,228	Ajax Mortgage Loan Trust 2018- B ' Series 2018-B A ' ' 144A ' 3.75% 26/2/2057	3,662,847	0.04
USD 4,542,324	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-E FRN 25/6/2058	4,680,592	0.04
USD 14,575,476	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-F ' Series 2018-F A ' ' 144A ' FRN 25/11/2058	14,806,819	0.14
USD 23,052,684	Ajax Mortgage Loan Trust 2019- C ' Series 2019-C A ' ' 144A ' FRN 25/10/2058	23,521,896	0.22
USD 18,700,000	Ajax Mortgage Loan Trust 2019- G (Step-up coupon) ' Series 2019-G A ' ' 144A ' 3% 25/9/2059	18,731,541	0.18
USD 11,500,000	Ajax Mortgage Loan Trust 2019- H (Step-up coupon) ' Series 2019-H A ' ' 144A ' 3% 25/11/2059	11,520,879	0.11
USD 863,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ' 144A ' 3.5% 15/2/2023	859,764	0.01
USD 459,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ' 144A ' 4.625% 5/1/2027	456,430	0.00
USD 340,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ' 144A ' 4.875% 15/2/2030	341,700	0.00
USD 1,423,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 5.75% 15/3/2025	1,476,953	0.01
USD 665,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ' 144A ' 5.875% 15/2/2028	699,480	0.01
USD 312,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 6.625% 15/6/2024	323,697	0.00
USD 695,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ' 144A ' 7.5% 15/3/2026	769,277	0.01
USD 25,660	Allegro CLO I Ltd ' Series 2013- 1A A1R ' ' 144A ' FRN 30/1/2026	25,670	0.00
USD 330,000	Allegro CLO I Ltd ' Series 2013- 1A C ' ' 144A ' FRN 30/1/2026	330,355	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,560,000	Allegro CLO II-S Ltd ' Series 2014-1RA B ' ' 144A ' FRN 21/10/2028	1,541,265	0.01
USD 2,270,000	Allegro CLO II-S Ltd ' Series 2014-1RA C ' ' 144A ' FRN 21/10/2028	2,185,306	0.02
USD 670,000	Allegro CLO IV Ltd ' Series 2016-1A AR ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	670,831	0.01
USD 1,790,000	Allegro CLO IV Ltd ' Series 2016-1A BR ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	1,790,371	0.02
USD 2,300,000	Allegro CLO IV Ltd ' Series 2016-1A CR ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	2,286,166	0.02
USD 250,000	Allegro CLO VI Ltd ' Series 2017-2A A ' ' 144A ' FRN 17/1/2031	249,626	0.00
USD 1,535,000	Allergan Sales LLC (Restricted) ' 144A ' 5% 15/12/2021	1,612,353	0.02
USD 2,080,000	ALM V Ltd ' Series 2012-5A A1R3 ' ' 144A ' FRN 18/10/2027	2,080,430	0.02
USD 1,700,000	ALM V Ltd ' Series 2012-5A BR3 ' ' 144A ' FRN 18/10/2027	1,681,526	0.02
USD 1,061,000	ALM VI Ltd ' Series 2012-6A A2R3 ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	1,059,085	0.01
USD 2,620,000	ALM VI Ltd ' Series 2012-6A CR3 ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	2,592,691	0.02
USD 3,100,000	ALM VI Ltd ' Series 2012-6A DR3 ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	3,054,342	0.03
USD 4,315,000	ALM VII Ltd ' Series 2012-7A SUB ' ' 144A ' FRN 15/10/2116	1,845,159	0.02
USD 1,190,000	ALM VII R Ltd ' Series 2013-7RA A1R ' ' 144A ' FRN 15/10/2028	1,190,204	0.01
USD 6,285,000	ALM VIII Ltd ' Series 2013-8A A1R ' ' 144A ' FRN 15/10/2028	6,286,454	0.06
USD 300,000	ALM VIII Ltd ' Series 2013-8A A2R ' ' 144A ' FRN 15/10/2028	300,045	0.00
USD 1,059,502	ALM XII Ltd ' Series 2015-12A A1R2 ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	1,059,472	0.01
USD 1,293,000	ALM XII Ltd ' Series 2015-12A BR2 ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	1,292,989	0.01
USD 950,000	ALM XII Ltd ' Series 2015-12A C1R2 ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	949,788	0.01
USD 460,000	ALM XII Ltd ' Series 2015-12A C2R2 ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	460,088	0.00
USD 340,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC FRN 15/7/2027	340,954	0.00
USD 2,250,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC ' 144A ' FRN 15/7/2027	2,185,983	0.02
USD 3,051,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC FRN 15/7/2027	3,049,621	0.03
USD 1,309,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC ' Series 2015-16A BR2 ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	1,291,848	0.01
USD 900,000	ALM XVII Ltd ' Series 2015-17A A1AR ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	900,891	0.01
USD 800,000	ALM XVII Ltd ' Series 2015-17A BR ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	800,481	0.01
USD 720,000	ALM XVII Ltd ' Series 2015-17A CR ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	716,860	0.01
USD 870,000	ALM XVIII Ltd ' Series 2016-18A A2R ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	871,022	0.01
USD 2,892,263	Alternative Loan Trust 2005- 22T1 ' Series 2005-22T1 A1 ' FRN 25/6/2035	2,537,852	0.02
USD 2,630,641	Alternative Loan Trust 2005-72 ' Series 2005-72 A3 ' FRN 25/1/2036	2,504,974	0.02
USD 921,437	Alternative Loan Trust 2005-76 ' Series 2005-76 2A1 ' FRN 25/2/2036	883,063	0.01
USD 3,223,500	Alternative Loan Trust 2005-J4 ' Series 2005-J4 B1 ' FRN 25/7/2035	3,231,267	0.03
USD 4,391,542	Alternative Loan Trust 2006-11CB ' Series 2006-11CB 3A1 ' 6.5% 25/5/2036	3,505,231	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,264,561	Alternative Loan Trust 2006- 15CB ' Series 2006-15CB A1 ' 6.5% 25/6/2036	948,102	0.01
USD 1,824,352	Alternative Loan Trust 2006- 23CB ' Series 2006-23CB 2A5 ' FRN 25/8/2036	567,035	0.01
USD 1,034,473	Alternative Loan Trust 2006-J7 ' Series 2006-J7 2A1 ' FRN 20/11/2046	769,628	0.01
USD 683,247	Alternative Loan Trust 2006- 0A11 ' Series 2006-0A11 A4 ' FRN 25/9/2046	650,211	0.01
USD 4,391,116	Alternative Loan Trust 2006- 0A14 ' Series 2006-0A14 1A1 ' FRN 25/11/2046	3,969,388	0.04
USD 3,240,121	Alternative Loan Trust 2006- 0A16 ' Series 2006-0A16 A4C ' FRN 25/10/2046	2,341,133	0.02
USD 591,493	Alternative Loan Trust 2006-0A8 ' Series 2006-0A8 1A1 ' FRN 25/7/2046	566,943	0.01
USD 1,415,277	Alternative Loan Trust 2006- 0C10 ' Series 2006-0C10 2A3 ' FRN 25/11/2036	1,208,325	0.01
USD 5,692,599	Alternative Loan Trust 2006- 0C7 ' Series 2006-0C7 2A3 ' FRN 25/7/2046	5,006,459	0.05
USD 4,154,384	Alternative Loan Trust 2007-25 ' Series 2007-25 1A3 ' 6.5% 25/11/2037	3,204,305	0.03
USD 6,186,846	Alternative Loan Trust 2007-3T1 ' Series 2007-3T1 1A1 ' 6% 25/4/2037	4,331,742	0.04
USD 3,583,904	Alternative Loan Trust 2007-9T1 ' Series 2007-9T1 1A1 ' 6% 25/5/2037	2,493,487	0.02
USD 1,299,463	Alternative Loan Trust 2007- 0A3 ' Series 2007-0A3 1A1 ' FRN 25/4/2047	1,204,492	0.01
USD 70,831	Alternative Loan Trust 2007- 0A3 ' Series 2007-0A3 2A2 ' FRN 25/4/2047	15,955	0.00
USD 330,380	Alternative Loan Trust 2007- 0A8 ' Series 2007-0A8 2A1 ' FRN 25/6/2047	271,620	0.00
USD 407,014	Alternative Loan Trust 2007- 0H2 ' Series 2007-0H2 A2A ' FRN 25/8/2047	342,885	0.00
USD 671,973	Ambac Assurance Corp ' 144A ' 5.1% 7/6/2020	999,821	0.01
USD 906,000	AMC Networks Inc 4.75% 1/8/2025	909,701	0.01
USD 587,000	AMC Networks Inc 5% 1/4/2024	594,338	0.01
USD 717,291	American Airlines 2015-2 Class B Pass Through Trust 4.4% 22/9/2023	755,805	0.01
USD 2,363,000	American Airlines Group Inc ' 144A ' 4.625% 1/3/2020	2,363,000	0.02
USD 13,111,000	American Airlines Pass Through Certificate 3.5% 15/12/2027	13,422,386	0.13
USD 2,035,000	American Airlines Pass Through Certificate 4% 15/12/2025	2,060,438	0.02
USD 10,453,000	American Airlines Pass Through Certificate ' 2019-1C ' 4% 15/6/2022	10,479,133	0.10
USD 525,000	American Builders & Contractors Supply Co Inc ' 144A ' 4% 15/1/2028	512,899	0.01
USD 249,000	American Builders & Contractors Supply Co Inc ' 144A ' 5.875% 15/5/2026	257,553	0.00
USD 3,618,000	American Energy- Permian Basin LLC ' 144A ' 12% 1/10/2024	2,541,645	0.02
USD 1,076,758	American Home Mortgage Assets Trust 2006-3 ' Series 2006-3 2A11 ' FRN 25/10/2046	973,658	0.01
USD 2,330,967	American Home Mortgage Assets Trust 2006-4 ' Series 2006-4 1A12 ' FRN 25/10/2046	1,614,411	0.02
USD 3,899,645	American Home Mortgage Assets Trust 2006-5 ' Series 2006-5 A1 ' FRN 25/11/2046	1,847,117	0.02
USD 716,400	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 ' Series 2007-1 A1 ' FRN 25/2/2047	433,017	0.00
USD 1,876,000	American Homes 4 Rent 2014- SFR2 Trust ' Series 2014- SFR2 E ' ' 144A ' 6.231% 17/10/2036	2,100,992	0.02
USD 5,121,212	American Homes 4 Rent 2015- SFR1 ' Series 2015-SFR1 XS ' ' 144A ' FRN 17/4/2052	51	0.00
USD 725,000	American Municipal Power Inc 6.449% 15/2/2044	1,093,481	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国 (続き)		
USD 1,345,000	American Municipal Power Inc 7.834% 15/2/2041	2,268,786	0.02
EUR 3,590,000	American Tower Corp 1.95% 22/5/2026	4,300,576	0.04
USD 4,195,000	American Tower Corp 5% 15/2/2024	4,689,966	0.04
USD 4,283,000	American University/The 3.672% 1/4/2049	5,006,989	0.05
USD 550,000	AmericoId 2010 LLC ' Series 2010-ARTA C ' ' 144A ' 6.811% 14/1/2029	560,550	0.01
USD 530,000	AMMC CLO 21 Ltd ' Series 2017-21A A ' ' 144A ' FRN 2/11/2030	531,977	0.01
USD 1,675,000	AMMC CLO XII Ltd ' Series 2013-12A AR ' ' 144A ' FRN 10/11/2030	1,677,949	0.02
USD 3,100,000	AMMC CLO XIII Ltd ' Series 2013-13A A1LR ' ' 144A ' FRN 24/7/2029	3,116,181	0.03
USD 3,050,000	AMMC CLO XIV Ltd ' Series 2014-14A A1LR ' ' 144A ' FRN 25/7/2029	3,064,880	0.03
USD 2,771,000	AMN Healthcare Inc ' 144A ' 5.125% 1/10/2024	2,855,280	0.03
USD 2,350,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R Ltd ' Series 2018-1RA A1 ' ' 144A ' FRN 13/4/2031	2,346,756	0.02
USD 840,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd ' Series 2013-1A A1R ' ' 144A ' FRN 13/10/2030	842,494	0.01
USD 1,070,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd ' Series 2013-1A A2R ' ' 144A ' FRN 13/10/2030	1,070,093	0.01
USD 340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd ' Series 2013-1A BR ' ' 144A ' FRN 13/10/2030	337,295	0.00
USD 417,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd ' Series 2013-1A CR ' ' 144A ' FRN 13/10/2030	414,553	0.00
USD 1,040,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd ' Series 2013-1A DR ' ' 144A ' FRN 13/10/2030	1,031,705	0.01
USD 1,050,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd ' Series 2014-3RA A ' ' 144A ' FRN 28/1/2031	1,047,899	0.01
USD 1,650,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd ' Series 2014-3RA B ' ' 144A ' FRN 28/1/2031	1,623,244	0.02
USD 250,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd ' Series 2014-3RA D ' ' 144A ' FRN 28/1/2031	239,161	0.00
USD 1,920,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd ' Series 2014-4RA A ' ' 144A ' FRN 28/1/2031	1,915,178	0.02
USD 1,500,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd ' Series 2014-4RA C ' ' 144A ' FRN 28/1/2031	1,488,419	0.01
USD 5,475,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd ' Series 2014-5RA B ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	5,465,839	0.05
USD 1,300,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd ' Series 2014-5RA C ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	1,271,675	0.01
USD 1,570,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd ' Series 2015-6A AR ' ' 144A ' FRN 15/7/2030	1,571,759	0.02
USD 590,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd ' Series 2015-6A DR ' ' 144A ' FRN 15/7/2030	591,692	0.01
USD 11,843,885	Anchorage Capital CLO 7 Ltd ' Series 2015-7A AR ' ' 144A ' FRN 15/10/2027	11,850,029	0.11
USD 1,500,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd ' Series 2015-7A B1R ' ' 144A ' FRN 15/10/2027	1,493,943	0.01
USD 4,278,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd ' Series 2015-7A CR ' ' 144A ' FRN 15/10/2027	4,289,763	0.04
USD 3,665,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd ' Series 2015-7A DR ' ' 144A ' FRN 15/10/2027	3,660,695	0.04
USD 2,500,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd ' Series 2015-7A ER ' ' 144A ' FRN 15/10/2027	2,482,078	0.02
USD 1,150,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ' Series 2016-8A AR ' ' 144A ' FRN 28/7/2028	1,149,897	0.01
USD 3,895,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ' Series 2016-8A BR ' ' 144A ' FRN 28/7/2028	3,896,908	0.04
USD 5,810,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ' Series 2016-8A CR ' ' 144A ' FRN 28/7/2028	5,793,900	0.06
USD 1,850,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ' Series 2016-8A DR ' ' 144A ' FRN 28/7/2028	1,842,679	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国 (続き)		
USD 4,030,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ' Series 2016-8A ER ' ' 144A ' FRN 28/7/2028	3,952,539	0.04
EUR 180,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 DAC FRN 15/5/2031	199,119	0.00
USD 1,460,000	Apache Corp 4.75% 15/4/2043	1,402,104	0.01
USD 700,000	Apidos CLO XII ' Series 2013- 12A AR ' ' 144A ' FRN 15/4/2031	698,656	0.01
USD 1,290,000	Apidos CLO XV ' Series 2013- 15A A1RR ' ' 144A ' FRN 20/4/2031	1,290,127	0.01
USD 500,000	Apidos CLO XXI ' Series 2015- 21A CR ' ' 144A ' FRN 18/7/2027	492,615	0.00
USD 640,000	Apidos CLO XXIX ' Series 2018- 29A D ' ' 144A ' FRN 25/7/2030	598,260	0.01
USD 1,000,000	Apidos CLO XXXI ' Series 2019- 31A B ' ' 144A ' FRN 15/4/2031	1,002,418	0.01
USD 7,724,000	Apple Inc 2.95% 11/9/2049*	8,001,157	0.08
USD 6,440,002	APS Resecuritization Trust 2016-1 ' Series 2016-1 1MZ ' ' 144A ' FRN 31/7/2057	2,768,822	0.03
USD 4,483,940	APS Resecuritization Trust 2016-3 ' Series 2016-3 3A ' ' 144A ' FRN 27/9/2046	4,550,055	0.04
USD 868,679	APS Resecuritization Trust 2016-3 ' Series 2016-3 4A ' ' 144A ' FRN 27/4/2047	877,346	0.01
USD 569,000	Aramark Services Inc 4.75% 1/6/2026	584,956	0.01
USD 1,311,000	Aramark Services Inc ' 144A ' 5% 1/2/2028	1,372,420	0.01
USD 3,460,000	Arbor Realty Collateralized Loan Obligation 2017-FL3 Ltd ' Series 2017-FL3 A ' ' 144A ' FRN 15/12/2027	3,467,162	0.03
USD 1,330,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL2 Ltd ' Series 2017-FL2 A ' ' 144A ' FRN 15/8/2027	1,331,081	0.01
USD 433,000	Arconic Inc 5.125% 1/10/2024	468,482	0.00
USD 280,000	Arconic Inc 5.4% 15/4/2021	285,999	0.00
USD 1,520,000	Arconic Inc 5.87% 23/2/2022	1,605,971	0.02
USD 7,540,000	Arconic Inc 5.9% 1/2/2027	8,633,941	0.08
USD 400,000	Ares XLI Clo Ltd ' Series 2016- 41A D ' ' 144A ' FRN 15/1/2029	401,191	0.00
USD 200,000	ARES XLIV CLO Ltd ' Series 2017-44A D ' ' 144A ' FRN 15/10/2029	198,682	0.00
USD 375,000	ARES XLV CLO Ltd ' Series 2017-45A C ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	368,535	0.00
USD 104,954	Ares XXIX CLO Ltd ' Series 2014-1A A1R ' ' 144A ' FRN 17/4/2026	104,953	0.00
USD 250,000	Ares XXXIV CLO Ltd ' Series 2015-2A BR ' ' 144A ' FRN 29/7/2026	250,055	0.00
USD 500,000	Ares XXXIV CLO Ltd ' Series 2015-2A E1 ' ' 144A ' FRN 29/7/2026	501,042	0.00
USD 1,500,000	Ares XXXVII CLO Ltd ' Series 2015-4A A1R ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	1,505,075	0.01
USD 560,000	Ares XXXVII CLO Ltd ' Series 2015-4A DR ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	548,793	0.01
USD 4,473,946	Argent Mortgage Loan Trust 2005-W1 ' Series 2005-W1 A2 ' FRN 25/5/2035	4,299,098	0.04
USD 2,800,000	ARI Investments LLC 6/1/2025 (Zero Coupon)	2,800,000	0.03
USD 1,905,000	Arizona Health Facilities Authority FRN 1/1/2037	1,900,276	0.02
USD 5,085,000	Arrow Bidco LLC ' 144A ' 9.5% 15/3/2024	4,998,123	0.05
USD 894,000	Ashford Hospitality Trust 2018- ASHF ' Series 2018-ASHF D ' ' 144A ' FRN 15/4/2035	894,497	0.01
USD 3,777,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co ' 144A ' 6.625% 15/1/2028	3,824,213	0.04
USD 822,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co ' 144A ' 6.75% 1/8/2025	853,166	0.01
USD 5,505,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co ' 144A ' 9.875% 1/4/2027	6,263,850	0.06

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,744	Asset Securitization Corp ' Series 1997-D5 B2 ' 6.93% 14/2/2043	5,746	0.00
USD 1,040,000	ASSURANT CLO I Ltd ' Series 2017-1A B ' ' 144A ' FRN 20/10/2029	1,040,022	0.01
USD 370,000	ASSURANT CLO III Ltd ' Series 2018-2A C ' ' 144A ' FRN 20/10/2031	362,159	0.00
EUR 2,900,000	AT&T Inc FRN 2/3/2025 (Perpetual)	3,128,180	0.03
GBP 2,805,000	AT&T Inc 2.9% 4/12/2026	3,854,159	0.04
USD 6,180,000	AT&T Inc 4.35% 1/3/2029*	6,978,176	0.07
USD 4,410,000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM ' Series 2017- ATRM D ' ' 144A ' FRN 15/12/2036	4,412,183	0.04
USD 824,447	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM ' Series 2017- ATRM E ' ' 144A ' FRN 15/12/2036	827,068	0.01
USD 1,490,000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2018-ATRM ' Series 2018- ATRM E ' ' 144A ' FRN 15/6/2035	1,496,585	0.01
USD 985,000	Atrium XII ' 144A ' FRN 22/4/2027	986,284	0.01
USD 1,385,000	Atrium XII ' 144A ' FRN 22/4/2027	1,368,707	0.01
USD 845,000	AvalonBay Communities Inc 2.3% 1/3/2030	852,816	0.01
USD 1,477,000	Avantor Inc ' 144A ' 6% 1/10/2024	1,565,007	0.02
USD 5,000,000	Aventura Mall Trust 2013-AVM ' Series 2013-AVM D ' ' 144A ' FRN 5/12/2032	5,027,141	0.05
USD 4,243,419	Avery Point IV CLO Ltd ' Series 2014-1A AR ' ' 144A ' FRN 25/4/2026	4,245,038	0.04
USD 1,085,683	Avery Point V CLO Ltd ' Series 2014-5A AR ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	1,086,862	0.01
USD 520,000	Avery Point V CLO Ltd ' Series 2014-5A BR ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	521,410	0.01
USD 2,800,000	Avery Point VI CLO Ltd ' Series 2015-6A AR ' ' 144A ' FRN 5/8/2027	2,804,866	0.03
USD 4,630,000	Avery Point VI CLO Ltd ' Series 2015-6A BR ' ' 144A ' FRN 5/8/2027	4,592,634	0.04
USD 780,000	Aviation Capital Group LLC ' 144A ' 7.125% 15/10/2020	805,219	0.01
USD 389,000	Azul Investments LLP ' 144A ' 5.875% 26/10/2024*	388,088	0.00
USD 3,469,902	B2R Mortgage Trust 2015-2 ' Series 2015-2 XA ' ' 144A ' FRN 15/11/2048	32,270	0.00
USD 289,655	B2R Mortgage Trust 2015-2 ' Series 2015-2 A ' ' 144A ' FRN 3.336% 15/11/2048	290,497	0.00
USD 1,250,000	Babson CLO Ltd 2015-II ' Series 2015-2A AR ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	1,250,619	0.01
USD 4,000,000	Bain Capital Credit Clo 2016-2 Ltd ' Series 2016-2A AR ' ' 144A ' FRN 15/1/2029	4,008,982	0.04
USD 2,650,000	Bain Capital Credit Clo 2016-2 Ltd ' Series 2016-2A BR ' ' 144A ' FRN 15/1/2029	2,650,509	0.03
USD 1,790,000	Bain Capital Credit CLO 2018-2 ' Series 2018-2A A1 ' ' 144A ' FRN 19/7/2031	1,793,297	0.02
EUR 296,000	Ball Corp 0.875% 15/3/2024	325,043	0.00
USD 255,000	Ball Corp 4.875% 15/3/2026	282,438	0.00
USD 340,000	Ball Corp 5.25% 1/7/2025	373,291	0.00
USD 1,147,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2015-200P ' Series 2015-200P F ' ' 144A ' FRN 14/4/2033	1,178,938	0.01
USD 230,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2016-ISQ ' Series 2016-ISQ C ' ' 144A ' FRN 14/8/2034	247,177	0.00
USD 4,306,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2016-ISQ ' Series 2016-ISQ E ' ' 144A ' FRN 14/8/2034	4,418,704	0.04
USD 5,860,000	BamII Commercial Mortgage Securities Trust 2016-SS1 ' Series 2016-SS1 XA ' ' 144A ' FRN 15/12/2035	183,066	0.00
USD 3,820,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017-SCH ' Series 2017-SCH CL ' ' 144A ' FRN 15/11/2032	3,859,566	0.04
USD 1,780,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017-SCH ' Series 2017-SCH DL ' ' 144A ' FRN 15/11/2032	1,797,106	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,430,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017-SCH ' Series 2017-SCH BF ' ' 144A ' FRN 15/11/2033	3,423,716	0.03
USD 2,676,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2018-DSNY ' Series 2018-DSNY D ' ' 144A ' FRN 15/9/2034	2,687,663	0.03
USD 1,500,000	BAMLL Trust 2011-FSHN ' Series 2011-FSHN B ' ' 144A ' 4.769% 11/7/2033	1,536,671	0.01
USD 3,580,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 ' Series 2016-UB10 C ' FRN 15/7/2049	3,936,645	0.04
USD 9,780,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 ' Series 2017-BNK3 XB ' FRN 15/2/2050	403,456	0.00
USD 4,000,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 ' Series 2017-BNK3 XD ' ' 144A ' FRN 15/2/2050	314,520	0.00
USD 461,425	Banc of America Funding 2006- A Trust ' Series 2006-A 3A2 ' FRN 20/2/2036	451,213	0.00
USD 15,017,081	Banc of America Funding 2014- R2 Trust ' Series 2014-R2 1C ' ' 144A ' FRN 26/11/2036	3,385,709	0.03
USD 967,969	Bancorp Commercial Mortgage 2018-CRE3 Trust/The ' Series 2018-CR3 A ' ' 144A ' FRN 15/1/2033	968,284	0.01
EUR 870,000	Banff Merger Sub Inc 8.375% 1/9/2026	990,210	0.01
USD 5,489,000	BANK 2019-BNK23 ' Series 2019-BN23 A3 ' 2.92% 15/12/2052	5,909,345	0.06
USD 11,280,000	Bank of America Corp FRN 5/9/2024 (Perpetual)	12,484,648	0.12
USD 2,927,000	Bank of America Corp FRN 23/10/2024 (Perpetual)	3,251,004	0.03
USD 748,000	Bank of America Corp FRN 10/3/2026 (Perpetual)	852,095	0.01
EUR 1,100,000	Bank of America Corp FRN 9/5/2026	1,234,297	0.01
USD 6,255,000	Bank of America Corp FRN 5/3/2029	6,975,024	0.07
USD 5,820,000	Bank of America Corp FRN 22/10/2030	6,023,078	0.06
USD 6,555,000	Bank of America Corp 4.183% 25/11/2027	7,231,877	0.07
USD 690,000	Bank of America NA 6% 15/10/2036	965,856	0.01
USD 1,500,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust ' Series 1997-2 B1 ' FRN 10/2/2022	1,000,572	0.01
USD 2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust ' Series 1998-2 B1 ' FRN 10/12/2025	1,309,087	0.01
USD 790,000	Barings CLO Ltd 2018-III FRN 20/7/2031	790,391	0.01
USD 630,000	Battalion CLO VII Ltd ' Series 2014-7A A1RR ' ' 144A ' FRN 17/7/2028	630,411	0.01
USD 4,438,000	Battalion CLO VII Ltd ' Series 2014-7A BRR ' ' 144A ' FRN 17/7/2028	4,445,375	0.04
USD 1,080,000	Battalion CLO XI Ltd ' Series 2017-11A E ' ' 144A ' FRN 24/10/2029	1,028,632	0.01
USD 723,000	Bausch Health Americas Inc ' 144A ' 8.5% 31/1/2027	803,000	0.01
USD 620,000	Bausch Health Americas Inc ' 144A ' 9.25% 1/4/2026	704,537	0.01
USD 4,480,000	Bay Area Toll Authority 2.425% 1/4/2026	4,741,229	0.05
USD 3,535,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	5,512,691	0.05
USD 6,185,000	Bay Area Toll Authority 7.043% 1/4/2050	11,214,209	0.11
USD 1,546,000	Baylor Scott & White Holdings 4.185% 15/11/2045	1,903,901	0.02
USD 239,419	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 ' Series 2005-4A A1 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	232,186	0.00
USD 67,374	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 ' Series 2005-4A A2 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	65,573	0.00
USD 178,060	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 ' Series 2005-4A M1 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	173,330	0.00
USD 259,846	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 ' Series 2006-1A A2 ' ' 144A ' FRN 25/4/2036	252,528	0.00
USD 747,058	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 ' Series 2006-1A M2 ' ' 144A ' FRN 25/4/2036	721,427	0.01
USD 179,764	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 ' Series 2006-1A M3 ' ' 144A ' FRN 25/4/2036	173,472	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 982,617	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 ' Series 2006-1A M4 ' ' 144A ' FRN 25/4/2036	951,602	0.01
USD 1,002,378	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 ' Series 2006-3A A1 ' ' 144A ' FRN 25/10/2036	967,429	0.01
USD 449,399	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 ' Series 2006-3A A2 ' ' 144A ' FRN 25/10/2036	434,555	0.00
USD 5,202,871	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 ' Series 2006-4A A1 ' ' 144A ' FRN 25/12/2036	5,057,338	0.05
USD 18,153,156	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 ' Series 2007-4A A1 ' ' 144A ' FRN 25/9/2037	17,220,616	0.16
USD 1,590,000	Bayview Commercial Asset Trust 2007-6 ' Series 2007-6A A4A ' ' 144A ' FRN 25/12/2037	1,522,757	0.01
USD 6,339,240	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B ' Series 2004-B A1 ' ' 144A ' FRN 28/5/2039	5,861,695	0.06
USD 2,171,909	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B ' Series 2004-B A2 ' ' 144A ' FRN 28/5/2039	2,021,008	0.02
USD 7,402,537	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A ' Series 2005-A A1 ' ' 144A ' FRN 28/2/2040	7,214,571	0.07
USD 834,906	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E ' Series 2005-E A1 ' ' 144A ' FRN 28/12/2040	812,706	0.01
USD 286,000	BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust ' Series 2017-DELC E ' ' 144A ' FRN 15/8/2036	286,920	0.00
USD 880,000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust ' Series 2018-CHRS E ' ' 144A ' FRN 5/8/2038	841,708	0.01
USD 877,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust ' Series 2018-TALL A ' ' 144A ' FRN 15/3/2037	876,895	0.01
USD 1,060,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust ' Series 2018-TALL D ' ' 144A ' FRN 15/3/2037	1,061,485	0.01
USD 20,840,000	BBCMS Trust 2015-SRCH ' Series 2015-SRCH XA ' ' 144A ' FRN 10/8/2035	1,183,087	0.01
USD 11,710,000	BBCMS Trust 2015-SRCH ' Series 2015-SRCH XB ' ' 144A ' FRN 10/8/2035	172,137	0.00
USD 100,000	BBCMS Trust 2015-STP ' Series 2015-STP E ' ' 144A ' FRN 10/9/2028	100,001	0.00
USD 1,627,547	BCMSC Trust 2000-A ' Series 2000-A A2 ' FRN 15/6/2030	577,336	0.01
USD 1,510,989	BCMSC Trust 2000-A ' Series 2000-A A3 ' FRN 15/6/2030	553,833	0.01
USD 1,089,739	BCMSC Trust 2000-A ' Series 2000-A A4 ' FRN 15/6/2030	422,643	0.00
USD 536,000	Beacon Roofing Supply Inc ' 144A ' 4.875% 1/11/2025	519,724	0.01
USD 130,000	Bean Creek CLO Ltd ' Series 2015-1A ER ' ' 144A ' FRN 20/4/2031	118,478	0.00
USD 665,870	Bear Stearns ALT-A Trust 2006- 6 ' Series 2006-6 1A1 ' FRN 25/11/2036	798,436	0.01
USD 2,848,859	Bear Stearns ALT-A Trust 2007- 1 ' Series 2007-1 1A1 ' FRN 25/1/2047	2,642,099	0.03
USD 101,268	Bear Stearns ARM Trust 2004-5 ' Series 2004-5 2A ' FRN 25/7/2034	102,588	0.00
USD 175,738	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-HE7 ' Series 2004-HE7 M2 ' FRN 25/8/2034	176,672	0.00
USD 2,743,056	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-AC9 (Step-up coupon) ' Series 2005-AC9 A5 ' 6.25% 25/12/2035	2,742,005	0.03
USD 3,755,577	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-AC1 (Step-up coupon) ' Series 2006-AC1 1A2 ' 6.25% 25/2/2036	3,522,050	0.03
USD 1,354,594	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE1 ' Series 2006-HE1 1M4 ' FRN 25/12/2035	1,858,015	0.02
USD 3,641,179	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE7 ' Series 2006-HE7 1A2 ' FRN 25/9/2036	4,724,354	0.05
USD 720,000	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE8 ' Series 2006-HE8 1A3 ' FRN 25/10/2036	654,020	0.01
USD 1,072,702	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-FS1 ' Series 2007-FS1 1A3 ' FRN 25/5/2035	1,192,849	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD	598,668 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE1 ' Series 2007-HE1 21A2 ' FRN 25/1/2037	594,409	0.01
USD	817,395 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 ' Series 2007-HE2 1A4 ' FRN 25/3/2037	676,017	0.01
USD	944,632 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 ' Series 2007-HE2 22A ' FRN 25/3/2037	942,924	0.01
USD	2,043,393 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 ' Series 2007-HE2 23A ' FRN 25/3/2037	2,199,655	0.02
USD	905,486 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 ' Series 2007-HE3 1A3 ' FRN 25/4/2037	1,006,513	0.01
USD	5,204,428 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 ' Series 2007-HE3 1A4 ' FRN 25/4/2037	4,907,785	0.05
USD	90,640 Bear Stearns Asset Backed Securities Trust 2005-4 ' Series 2005-4 M2 ' FRN 25/1/2036	90,786	0.00
USD	256,595 Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2005- PWR7 ' Series 2005- PWR7 B ' FRN 11/2/2041	256,859	0.00
USD	640,088 Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2007- TOP26 ' Series 2007- T26 AM ' FRN 12/1/2045	635,127	0.01
USD	795,184 Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2006-SL1 ' Series 2006- SL1 A1 ' FRN 25/8/2036	795,514	0.01
USD	544,356 Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 ' Series 2007- AR2 A1 ' FRN 25/3/2037	519,528	0.01
USD	844,063 Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 ' Series 2007- AR3 1A1 ' FRN 25/3/2037	805,916	0.01
USD	650,329 Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR4 ' Series 2007- AR4 2A1 ' FRN 25/6/2037	632,386	0.01
USD	3,293,000 Beazer Homes USA Inc ' 144A ' 7.25% 15/10/2029	3,516,315	0.03
EUR	320,000 Belden Inc 2.875% 15/9/2025*	358,168	0.00
EUR	400,000 Belden Inc 3.875% 15/3/2028	465,737	0.00
EUR	1,360,000 Belden Inc 4.125% 15/10/2026	1,592,499	0.02
USD	200,000 Benchmark 2018-B3 Mortgage Trust ' Series 2018-B3 D ' ' 144A ' FRN 10/4/2051	191,696	0.00
USD	11,065,000 Benefit Street Partners CLO II Ltd ' Series 2013-IIA A2R ' ' 144A ' FRN 15/7/2029	11,034,769	0.11
USD	500,000 Benefit Street Partners CLO II Ltd ' Series 2013-IIA CR ' ' 144A ' FRN 15/7/2029	469,286	0.00
USD	500,000 Benefit Street Partners CLO III Ltd ' Series 2013-IIIA A1R ' ' 144A ' FRN 20/7/2029	502,530	0.00
USD	750,000 Benefit Street Partners CLO V-B Ltd ' Series 2018-5BA A1A ' ' 144A ' FRN 20/4/2031	749,814	0.01
USD	5,972,000 Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' Series 2015-VIA A1R ' ' 144A ' FRN 18/10/2029	5,975,560	0.06
USD	1,440,000 Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' Series 2015-VIA A2R ' ' 144A ' FRN 18/10/2029	1,438,615	0.01
USD	610,000 Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' Series 2015-VIA CR ' ' 144A ' FRN 18/10/2029	611,365	0.01
USD	1,447,980 Benefit Street Partners CLO VII Ltd ' Series 2015-VIIA A1AR ' ' 144A ' FRN 18/7/2027	1,447,370	0.01
USD	300,000 Benefit Street Partners CLO VII Ltd ' Series 2015-VIIA CR ' ' 144A ' FRN 18/7/2027	300,178	0.00
USD	2,370,000 Benefit Street Partners CLO VII Ltd ' Series 2015-VIIA D ' ' 144A ' FRN 18/7/2027	2,356,176	0.02
USD	2,010,000 Benefit Street Partners CLO VIII Ltd ' Series 2015-8A A1AR ' ' 144A ' FRN 20/1/2031	2,009,506	0.02
USD	1,630,000 Berks County Industrial Development Authority 5% 1/11/2047	1,945,201	0.02
EUR	918,000 Berry Global Inc 1% 15/1/2025	993,095	0.01
USD	203,000 Berry Global Inc ' 144A ' 4.5% 15/2/2026	200,341	0.00
USD	522,000 Berry Global Inc ' 144A ' 4.875% 15/7/2026	536,080	0.01
USD	211,000 Berry Global Inc ' 144A ' 5.625% 15/7/2027	220,996	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,820,000	BHMS 2018-ATLS ' Series 2018-ATLS A ' ' 144A ' FRN 15/7/2035	4,829,533	0.05
USD 4,000,000	Black Diamond CLO 2013-1 Ltd ' Series 2013-1A A2R ' ' 144A ' FRN 6/2/2026	3,996,491	0.04
USD 187,036	Black Diamond CLO 2014-1 Ltd ' Series 2014-1A A1R ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	187,179	0.00
EUR 2,200,000	Blackstone Holdings Finance Co LLC 2% 19/5/2025*	2,638,258	0.03
USD 2,970,000	BlueMountain CLO 2013-2 Ltd ' Series 2013-2A A1R ' ' 144A ' FRN 22/10/2030	2,978,526	0.03
USD 480,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A C ' ' 144A ' FRN 13/4/2027	481,382	0.00
USD 889,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A D ' ' 144A ' FRN 13/4/2027	883,840	0.01
USD 530,000	BlueMountain CLO 2015-3 Ltd ' Series 2015-3A A1R ' ' 144A ' FRN 20/4/2031	527,615	0.01
USD 4,518,000	Boyd Gaming Corp ' 144A ' 4.75% 1/12/2027	4,479,010	0.04
USD 289,000	Boyd Gaming Corp 6% 15/8/2026	302,683	0.00
USD 3,758,000	Brinker International Inc ' 144A ' 5% 1/10/2024*	3,919,275	0.04
USD 418,000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL ' 144A ' 5.75% 15/5/2026	417,738	0.00
USD 1,000,000	Brookside Mill CLO Ltd 2013-1 ' Series 2013-1A BR ' ' 144A ' FRN 17/1/2028	995,703	0.01
USD 500,000	Brookside Mill CLO Ltd 2013-1 ' Series 2013-1A DR ' ' 144A ' FRN 17/1/2028	498,813	0.00
USD 5,498,000	Bruin E&P Partners LLC ' 144A ' 8.875% 1/8/2023	3,039,927	0.03
USD 204,000	Buckeye Partners LP 3.95% 1/12/2026	196,411	0.00
USD 2,594,000	Buckeye Partners LP ' 144A ' 4.125% 1/3/2025	2,600,978	0.02
USD 1,178,000	Buckeye Partners LP 4.15% 1/7/2023	1,180,945	0.01
USD 1,500,000	Buckeye Partners LP 4.35% 15/10/2024	1,481,250	0.01
USD 4,430,000	Buckeye Tobacco Settlement Financing Authority 5.875% 1/6/2047	4,436,091	0.04
USD 2,810,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust ' Series 2013-1515 A2 ' ' 144A ' 3.454% 10/3/2033	3,031,596	0.03
USD 2,730,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust ' Series 2013-1515 D ' ' 144A ' 3.633% 10/3/2033	2,873,895	0.03
USD 14,000,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust ' Series 2013-1515 E ' ' 144A ' 3.717% 10/3/2033	14,692,786	0.14
USD 2,818,000	BWAY 2015-1740 Mortgage Trust ' Series 2015-1740 E ' ' 144A ' FRN 10/1/2035	2,868,408	0.03
USD 1,110,000	BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA ' Series 2018-BIOA E ' ' 144A ' FRN 15/3/2037	1,111,694	0.01
USD 9,548,000	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND ' Series 2018-IND H ' ' 144A ' FRN 15/11/2035	9,562,124	0.09
USD 600,000	BXP Trust 2017-CC ' Series 2017-CC D ' ' 144A ' FRN 13/8/2037	632,168	0.01
USD 2,260,000	BXP Trust 2017-CC ' Series 2017-CC E ' ' 144A ' FRN 13/8/2037	2,343,668	0.02
USD 470,000	BXP Trust 2017-GM ' Series 2017-GM D ' ' 144A ' FRN 13/6/2039	497,866	0.00
USD 990,000	BXP Trust 2017-GM ' Series 2017-GM E ' ' 144A ' FRN 13/6/2039	1,013,183	0.01
USD 1,689,000	Caesars Entertainment Corp 5% 1/10/2024	3,065,763	0.03
USD 700,000	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc ' 144A ' 5.25% 15/10/2025	699,664	0.01
USD 605,000	California Health Facilities Financing Authority FRN 1/6/2032	642,359	0.01
USD 1,005,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2033	1,260,813	0.01
USD 1,560,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2047	1,882,904	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国 (続き)		
USD 1,970,000	California Pollution Control Financing Authority ' 144A ' 5% 21/11/2045	2,141,695	0.02
USD 1,735,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,834,773	0.03
USD 3,820,000	California State University 2.975% 1/11/2051	4,005,155	0.04
USD 2,300,172	California Street CLO XII Ltd ' Series 2013-12A AR ' ' 144A ' FRN 15/10/2025	2,300,796	0.02
USD 9,772,000	Calpine Corp ' 144A ' 4.5% 15/2/2028	9,533,075	0.09
USD 3,388,000	Calpine Corp ' 144A ' 5.125% 15/3/2028	3,299,065	0.03
USD 5,340,000	Calpine Corp ' 144A ' 5.25% 1/6/2026	5,432,502	0.05
USD 1,734,000	Cameron LNG LLC ' 144A ' 3.402% 15/1/2038	1,864,279	0.02
USD 1,540,000	Canaveral Port Authority 5% 1/6/2045	1,866,842	0.02
USD 1,540,000	Canaveral Port Authority 5% 1/6/2048	1,903,086	0.02
USD 1,859,000	Capital One Financial Corp FRN 1/6/2020 (Perpetual)	1,855,905	0.02
EUR 3,945,000	Capital One Financial Corp 0.8% 12/6/2024	4,424,127	0.04
USD 8,893,000	Capital One Financial Corp 3.9% 29/1/2024	9,536,292	0.09
USD 3,974,000	Capitol Investment Merger Sub 2 LLC ' 144A ' 10% 1/8/2024	4,091,571	0.04
USD 2,959,000	Carlson Travel Inc ' 144A ' 6.75% 15/12/2023	2,967,625	0.03
USD 2,260,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-2 Ltd ' Series 2013-2A AR ' ' 144A ' FRN 18/1/2029	2,249,348	0.02
USD 2,020,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 Ltd ' Series 2014-1A A1R2 ' ' 144A ' FRN 17/4/2031	2,017,352	0.02
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ' Series 2015-2A CR ' ' 144A ' FRN 27/4/2027	250,155	0.00
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ' Series 2015-2A DR ' ' 144A ' FRN 27/4/2027	239,810	0.00
USD 2,630,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd ' Series 2015-3A A2R ' ' 144A ' FRN 28/7/2028	2,633,576	0.03
USD 287,134	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd ' Series 2015-4A SBB1 ' ' 144A ' FRN 20/7/2032	279,954	0.00
USD 4,750,000	CARLYLE US CLO 2017-4 Ltd ' Series 2017-4A A1 ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	4,764,518	0.05
USD 4,787,000	Carpenter Technology Corp 4.45% 1/3/2023	5,066,910	0.05
USD 1,885,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE1 ' Series 2006-FRE1 A4 ' FRN 25/4/2036	1,639,412	0.02
USD 490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 ' Series 2006-NC1 M2 ' FRN 25/1/2036	418,070	0.00
USD 787,595	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC4 ' Series 2006-NC4 A3 ' FRN 25/10/2036	760,274	0.01
USD 1,442,589	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC5 ' Series 2006-NC5 A3 ' FRN 25/1/2037	1,182,800	0.01
USD 1,690,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-RFC1 ' Series 2007-RFC1 A4 ' FRN 25/10/2036	1,444,314	0.01
USD 750,000	CarVal CLO Ltd ' Series 2018- 1A D ' ' 144A ' FRN 16/7/2031	747,253	0.01
USD 790,000	CarVal CLO Ltd ' Series 2018- 1A E ' ' 144A ' FRN 16/7/2031	759,281	0.01
EUR 1,790,000	Catalent Pharma Solutions Inc 2.375% 1/3/2028	1,945,665	0.02
USD 7,500,000	CBAM 2017-1 Ltd ' Series 2017- 1A A1 ' ' 144A ' FRN 20/7/2030	7,500,625	0.07
USD 780,000	CBAM 2017-2 Ltd ' Series 2017- 2A B1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	780,110	0.01
USD 250,000	CBAM 2017-3 Ltd ' Series 2017- 3A B1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	250,006	0.00
USD 680,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ' 144A ' 4.5% 15/8/2030	689,775	0.01
USD 1,351,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ' 144A ' 5.125% 1/5/2027	1,419,496	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 616,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 1/6/2029	660,845	0.01
USD 624,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.5% 1/5/2026	648,662	0.01
USD 22,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.75% 15/1/2024	22,489	0.00
USD 530,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT 'Series 2016-HEAT D' '144A' FRN 10/4/2029	541,000	0.01
USD 16,000,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT 'Series 2016-HEAT X' '144A' FRN 10/4/2029	157,616	0.00
USD 952,500	CD 2006-CD3 Mortgage Trust 'Series 2006-CD3 AM' 5.648% 15/10/2048	987,028	0.01
USD 1,157,000	CDK Global Inc 5% 15/10/2024	1,259,927	0.01
USD 500,000	CDO Repack SPC Ltd 'Series 2006-CLF1 D1' '144A' 1% 20/5/2030	529,072	0.01
USD 569,000	Cedar Fair LP '144A' 5.25% 15/7/2029	580,010	0.01
USD 572,000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15/4/2027	590,317	0.01
USD 516,000	Cedar Funding II CLO Ltd 'Series 2013-1A A1R' '144A' FRN 9/6/2030	516,517	0.01
USD 2,600,000	Cedar Funding II CLO Ltd 'Series 2013-1A BR' '144A' FRN 9/6/2030	2,589,361	0.02
USD 1,000,000	Cedar Funding II CLO Ltd 'Series 2013-1A DR' '144A' FRN 9/6/2030	1,001,266	0.01
USD 1,290,000	Cedar Funding IX CLO Ltd 'Series 2018-9A A1' '144A' FRN 20/4/2031	1,300,963	0.01
USD 580,000	Cedar Funding IX CLO Ltd 'Series 2018-9A E' '144A' FRN 20/4/2031	538,515	0.01
USD 5,620,000	Cedar Funding VI CLO Ltd 'Series 2016-6A AR' '144A' FRN 20/10/2028	5,630,773	0.05
USD 1,200,000	Cedar Funding VI CLO Ltd 'Series 2016-6A DR' '144A' FRN 20/10/2028	1,158,433	0.01
USD 9,480,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd 'Series 2017-8A A1' '144A' FRN 17/10/2030	9,491,971	0.09
USD 580,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd 'Series 2017-8A B' '144A' FRN 17/10/2030	572,390	0.01
EUR 100,000	CEMEX Finance LLC 4.625% 15/6/2024	112,694	0.00
USD 3,400,000	Cent CLO 17 Ltd '144A' FRN 30/4/2031	3,391,787	0.03
USD 450,000	Cent CLO 19 Ltd 'Series 2013- 19A C' '144A' FRN 29/10/2025	451,249	0.00
USD 5,200,000	Cent CLO 24 Ltd 'Series 2015- 24A A1R' '144A' FRN 15/10/2026	5,197,357	0.05
USD 6,631,000	Centene Corp '144A' 3.375% 15/2/2030	6,606,134	0.06
USD 10,528,000	Centene Corp '144A' 4.25% 15/12/2027	10,916,483	0.10
USD 2,640,000	Centene Corp '144A' 4.625% 15/12/2029	2,829,816	0.03
USD 279,000	Centene Corp '144A' 5.25% 1/4/2025	288,974	0.00
USD 4,541,000	Centene Corp '144A' 5.375% 1/6/2026	4,800,881	0.05
USD 755,000	Centene Corp '144A' 5.375% 15/8/2026	802,905	0.01
USD 253,000	Centene Corp 6.125% 15/2/2024	261,020	0.00
USD 10,660,000	Centennial Resource Production LLC '144A' 5.375% 15/1/2026	9,197,954	0.09
USD 4,342,000	Centennial Resource Production LLC '144A' 6.875% 1/4/2027	3,930,910	0.04
USD 1,650,000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 5% 1/11/2050	1,962,362	0.02
USD 740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2045	867,757	0.01
USD 740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2046	876,182	0.01
USD 10,321,000	Century Communities Inc 6.75% 1/6/2027	11,170,651	0.11

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 515,000	CenturyLink Inc '144A' 4% 15/2/2027	523,858	0.01
USD 518,000	CenturyLink Inc '144A' 5.125% 15/12/2026	524,423	0.01
USD 211,000	CenturyLink Inc 5.625% 1/4/2025	221,638	0.00
USD 412,000	CenturyLink Inc 7.5% 1/4/2024	464,153	0.00
USD 5,430,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 'Series 2016-C3 XD' '144A' FRN 10/1/2048	503,833	0.01
USD 2,497,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 C' FRN 10/5/2058	2,750,195	0.03
USD 5,439,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 XB' FRN 10/5/2058	231,484	0.00
USD 1,080,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 'Series 2018- TAN C' '144A' 5.295% 15/2/2033	1,153,394	0.01
USD 2,283,859	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017- BIOC A' '144A' FRN 15/7/2032	2,285,728	0.02
USD 3,526,278	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017- BIOC D' '144A' FRN 15/7/2032	3,532,886	0.03
USD 5,947,168	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017- BIOC E' '144A' FRN 15/7/2032	5,958,972	0.06
USD 444,000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.25% 1/5/2028	450,815	0.00
USD 129,000	Charles River Laboratories International Inc '144A' 5.5% 1/4/2026	136,395	0.00
USD 188,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital FRN 1/2/2024	194,123	0.00
USD 12,126,556	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 'Series 2007- S6 1A1' 6% 25/12/2037	8,866,425	0.08
USD 5,520,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC '144A' 3.7% 15/11/2029	5,576,010	0.05
USD 9,623,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.125% 30/6/2027	10,643,336	0.10
USD 1,199,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.875% 31/3/2025	1,342,470	0.01
USD 4,905,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7% 30/6/2024	5,644,599	0.05
USD 15,539,289	Cheniere Energy Inc '144A' 4.875% 28/5/2021	15,653,770	0.15
USD 2,360,000	Cheniere Energy Partners LP '144A' 4.5% 1/10/2029	2,258,166	0.02
USD 7,549,000	Cheniere Energy Partners LP 5.25% 1/10/2025	7,607,052	0.07
USD 1,635,000	Cheniere Energy Partners LP 5.625% 1/10/2026	1,646,402	0.02
USD 730,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2041	890,129	0.01
USD 575,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2051	682,442	0.01
USD 1,501,000	Chesapeake Energy Corp 4.875% 15/4/2022	889,811	0.01
USD 250,000	Chesapeake Energy Corp 5.375% 15/6/2021*	187,600	0.00
USD 1,500,000	Chesapeake Energy Corp 5.75% 15/3/2023	766,447	0.01
USD 5,976,000	Chesapeake Energy Corp 6.125% 15/2/2021*	4,544,150	0.04
USD 6,848,000	Chesapeake Energy Corp 6.625% 15/8/2020	6,388,414	0.06
USD 9,537,000	Chesapeake Energy Corp '144A' 11.5% 1/1/2025	5,746,042	0.05
USD 2,567,583	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA4 'Series 2006- OA4 A1' FRN 25/4/2046	1,231,548	0.01
USD 600,132	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA5 'Series 2006- OA5 3A1' FRN 25/4/2046	579,483	0.01
USD 6,613,130	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 'Series 2007- 15 2A2' 6.5% 25/9/2037	4,567,692	0.04
USD 444,000	Churchill Downs Inc '144A' 4.75% 15/1/2028	447,334	0.00
USD 684,000	Churchill Downs Inc '144A' 5.5% 1/4/2027	712,625	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2013-I Ltd 'Series 2013-1A A2R' '144A' FRN 16/7/2030	249,358	0.00
USD 11,000,000	CIFC Funding 2013-II Ltd 'Series 2013-2A A1LR' '144A' FRN 18/10/2030	11,025,698	0.10

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 250,000	CIFC Funding 2014 Ltd ' Series 2014-1A A1R2 ' ' 144A ' FRN 18/1/2031	250,024	0.00
USD 12,650,000	Cifc Funding 2014-IV-R Ltd ' Series 2014-4RA A1A ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	12,654,655	0.12
USD 395,000	Cifc Funding 2014-IV-R Ltd ' Series 2014-4RA A2 ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	393,162	0.00
USD 250,000	CIFC Funding 2015-II Ltd FRN 15/4/2027	250,139	0.00
USD 735,072	CIFC Funding 2015-II Ltd ' Series 2015-2A AR ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	735,405	0.01
USD 1,940,000	CIFC Funding 2015-II Ltd ' Series 2015-2A CR ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	1,934,474	0.02
USD 250,000	CIFC Funding 2015-II Ltd ' Series 2015-2A DR ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	250,139	0.00
USD 3,780,000	CIFC Funding 2017-I Ltd ' Series 2017-1A B ' ' 144A ' FRN 23/4/2029	3,775,978	0.04
USD 2,730,000	CIFC Funding 2017-I Ltd ' Series 2017-1A C ' ' 144A ' FRN 23/4/2029	2,726,515	0.03
USD 1,000,000	CIFC Funding 2017-II Ltd ' Series 2017-2A A ' ' 144A ' FRN 20/4/2030	1,000,192	0.01
USD 600,000	CIFC Funding 2017-V Ltd ' Series 2017-5A C ' ' 144A ' FRN 16/11/2030	600,799	0.01
USD 2,791,000	Citgo Holding Inc ' 144A ' 9.25% 1/8/2024	2,937,527	0.03
USD 1,706,135	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-9 ' Series 2007-9 1A1 ' 6.25% 25/12/2037	1,538,825	0.01
USD 2,199,479	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2008-2 ' Series 2008-2 1A1 ' 6.5% 25/6/2038	1,952,696	0.02
USD 2,290,000	Citicorp Residential Mortgage Trust Series 2007-2 (Step-up coupon) ' Series 2007-2 M1 ' 5.07% 25/6/2037	2,317,489	0.02
USD 1,700,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 ' Series 2014-GC19 C ' FRN 10/3/2047	1,884,617	0.02
USD 4,250,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 ' Series 2015- GC27 C ' FRN 10/2/2048	4,483,796	0.04
USD 113,443	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-SHP2 ' Series 2015-SHP2 F ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	113,672	0.00
USD 100,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3 ' Series 2016-P3 C ' FRN 15/4/2049	111,275	0.00
USD 308,983	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3 ' Series 2016-P3 D ' ' 144A ' FRN 15/4/2049	283,401	0.00
USD 12,243,000	Citigroup Inc FRN 30/1/2025 (Perpetual)	12,250,652	0.12
GBP 1,130,000	Citigroup Inc 5.15% 21/5/2026	1,760,946	0.02
USD 5,388,775	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 ' Series 2007-AHL2 A3B ' FRN 25/5/2037	4,155,807	0.04
USD 1,847,250	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 ' Series 2007-AHL2 A3C ' FRN 25/5/2037	1,436,719	0.01
USD 2,791,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-WFHE2 ' Series 2007-WFH2 M3 ' FRN 25/3/2037	2,703,717	0.03
USD 2,610,000	Citigroup Mortgage Loan Trust Inc ' Series 2006-WFH4 M3 ' FRN 25/11/2036	2,377,623	0.02
USD 840,000	City of Atlanta GA Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2040	1,000,826	0.01
USD 3,475,000	City of New York NY 2.85% 1/8/2031	3,729,127	0.04
USD 5,715,000	City of New York NY 2.9% 1/8/2032	6,130,881	0.06
USD 1,360,000	City of New York NY 6.271% 1/12/2037	2,028,658	0.02
USD 500,000	City of Philadelphia PA Airport Revenue 5% 1/7/2042	605,518	0.01
USD 1,105,000	City of Riverside CA Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,897,733	0.02
USD 2,895,000	Claremont Mckenna College 3.378% 1/1/2050	3,169,697	0.03
USD 617,000	Clean Harbors Inc ' 144A ' 4.875% 15/7/2027	649,022	0.01
USD 216,000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc ' 144A ' 5.125% 15/8/2027	217,955	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,400,000	Clear Creek CLO 'Series 2015- 1A DR ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	1,401,034	0.01
USD 1,375,000	Clear Creek CLO 'Series 2015- 1A ER ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	1,289,952	0.01
USD 975,000	CNX Resources Corp 5.875% 15/4/2022	911,440	0.01
USD 687,000	Colfax Corp ' 144A ' 6% 15/2/2024	716,002	0.01
USD 720,000	Colorado Health Facilities Authority 5.25% 1/2/2031	748,840	0.01
EUR 1,090,000	Comcast Corp 0.25% 20/5/2027	1,200,810	0.01
USD 45,000	Comcast Corp 4% 1/3/2048	52,671	0.00
USD 1,795,000	Comcast Corp 4.95% 15/10/2058	2,422,181	0.02
USD 290,221	COMM 2005-C6 Mortgage Trust ' Series 2005-C6 F ' ' 144A ' FRN 10/6/2044	293,272	0.00
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust ' Series 2013-300P D ' ' 144A ' ' FRN 10/8/2030	105,907	0.00
USD 2,795,000	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust ' Series 2013- CR12 B ' FRN 10/10/2046	2,967,252	0.03
USD 640,000	COMM 2013-GAM ' Series 2013-GAM A2 ' ' 144A ' 3.367% 10/2/2028	643,673	0.01
USD 1,740,000	COMM 2013-WWP Mortgage Trust ' Series 2013-WWP D ' ' 144A ' 3.898% 10/3/2031	1,855,306	0.02
USD 1,500,000	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust ' Series 2014- CR15 C ' FRN 10/2/2047	1,638,513	0.02
USD 1,314,000	COMM 2014-UBS4 Mortgage Trust ' Series 2014-UBS4 C ' FRN 10/8/2047	1,392,266	0.01
USD 880,000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust ' Series 2015- CR25 C ' FRN 10/8/2048	954,204	0.01
USD 4,718,630	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust ' Series 2015- CR25 XA ' FRN 10/8/2048	179,498	0.00
USD 1,166,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust ' Series 2015-LC19 D ' ' 144A ' ' FRN 10/2/2048	1,120,197	0.01
USD 1,500,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust ' Series 2015-LC21 C ' FRN 10/7/2048	1,611,077	0.02
USD 1,380,000	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust ' Series 2015-LC23 A4 ' 3.774% 10/10/2048	1,518,733	0.01
USD 1,100,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust ' Series 2016-667M D ' ' 144A ' ' FRN 10/10/2036	1,132,229	0.01
USD 116,665,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust ' Series 2016-667M XA ' ' 144A ' FRN 10/10/2036	565,825	0.01
USD 740,000	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust ' Series 2017-COR2 D ' ' 144A ' ' 3% 10/9/2050	699,985	0.01
USD 3,050,000	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust ' Series 2018-COR3 XD ' ' 144A ' FRN 10/5/2051	375,399	0.00
USD 3,747,000	Commercial Metals Co 4.875% 15/5/2023	3,896,449	0.04
USD 5,416,000	Commercial Metals Co 5.375% 15/7/2027	5,607,442	0.05
USD 1,634,000	Commercial Metals Co 5.75% 15/4/2026	1,703,237	0.02
USD 46,324	Commercial Mortgage Trust 2006-GG7 ' Series 2006-GG7 AM ' FRN 10/7/2038	46,640	0.00
USD 1,568,000	CommonSpirit Health 3.347% 1/10/2029	1,648,712	0.02
USD 1,627,000	CommonSpirit Health 4.187% 1/10/2049	1,775,787	0.02
USD 1,285,000	CommonSpirit Health 4.35% 1/11/2042	1,433,875	0.01
USD 10,965,000	Commonwealth Financing Authority 3.807% 1/6/2041	13,151,914	0.13
USD 1,070,000	Commonwealth Financing Authority 3.864% 1/6/2038	1,234,063	0.01
USD 1,455,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038	1,732,003	0.02
USD 2,705,000	Commonwealth of Massachusetts 2.9% 1/9/2049	2,827,104	0.03
USD 3,040,000	CommScope Inc ' 144A ' 5.5% 15/6/2024	2,929,010	0.03
USD 2,935,000	CommScope Inc ' 144A ' 6% 1/3/2026	3,044,106	0.03
USD 3,890,000	CommScope Inc ' 144A ' 8.25% 1/3/2027	3,974,997	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,531,000	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC ' 144A ' 6.75% 1/10/2026	3,623,689	0.03
USD 1,400,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	1,620,850	0.02
USD 2,075,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	2,414,895	0.02
USD 1,471,628	Conseco Finance Corp ' Series 1997-3 M1 ' FRN 15/3/2028	1,490,339	0.01
USD 863,309	Conseco Finance Corp ' Series 1997-6 M1 ' FRN 15/1/2029	883,907	0.01
USD 888,996	Conseco Finance Corp ' Series 1999-5 A5 ' FRN 1/3/2030	585,550	0.01
USD 953,449	Conseco Finance Corp ' Series 1999-5 A6 ' FRN 1/3/2030	605,889	0.01
USD 279,411	Conseco Finance Corp ' Series 1998-4 M1 ' FRN 1/4/2030	256,096	0.00
USD 690,366	Conseco Finance Corp ' Series 1998-6 M1 ' FRN 1/6/2030	670,922	0.01
USD 2,079,058	Conseco Finance Corp ' Series 1998-8 M1 ' FRN 1/9/2030	1,903,465	0.02
USD 772,969	Conseco Finance Corp ' Series 1998-8 A1 ' 6.28% 1/9/2030	821,909	0.01
USD 1,320,105	Conseco Finance Securitizations Corp ' Series 2000-1 A5 ' FRN 1/9/2029	541,759	0.01
USD 1,650,955	Conseco Finance Securitizations Corp ' Series 2000-4 A6 ' FRN 1/5/2032	688,639	0.01
USD 1,894,522	Conseco Finance Securitizations Corp ' Series 2000-5 A6 ' 7.96% 1/5/2031	994,930	0.01
USD 4,603,816	Conseco Finance Securitizations Corp ' Series 2000-4 A5 ' 7.97% 1/5/2032	1,842,493	0.02
USD 3,448,057	Conseco Finance Securitizations Corp ' Series 2000-5 A7 ' 8.2% 1/5/2031	1,862,728	0.02
USD 896,000	Conservation Fund A Nonprofit Corp/The 3.474% 15/12/2029	954,390	0.01
USD 143	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	147	0.00
USD 890,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	1,286,397	0.01
USD 960,000	Cottage Health Obligated Group 3.304% 1/11/2049	1,044,178	0.01
EUR 300,000	Coty Inc 4% 15/4/2023	330,174	0.00
EUR 100,000	Coty Inc 4.75% 15/4/2026	112,800	0.00
USD 4,800,000	Countrywide Asset-Backed Certificates ' Series 2006-BC4 M1 ' FRN 25/11/2036	4,314,688	0.04
USD 1,123,891	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) ' Series 2006-S3 A4 ' 6.546% 25/1/2029	1,202,980	0.01
USD 1,000,000	County of Broward FL Airport System Revenue 2.814% 1/10/2031	1,051,205	0.01
USD 890,000	County of Broward FL Airport System Revenue 2.914% 1/10/2032	939,106	0.01
USD 3,560,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.529% 1/10/2030	3,708,826	0.04
USD 455,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 1/10/2029	491,302	0.00
USD 835,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.454% 1/10/2030	904,927	0.01
USD 780,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.504% 1/10/2031	845,672	0.01
USD 1,545,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 4.062% 1/10/2031	1,753,590	0.02
USD 1,810,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	2,124,732	0.02
USD 1,560,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2040	1,923,979	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 831,796	Credit Suisse ABS Repackaging Trust 2013-A ' Series 2013-A B ' ' 144A ' 2.5% 25/1/2030	817,904	0.01
USD 7,924	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' Series 2005-C2 AMFX ' 4.877% 15/4/2037	7,986	0.00
USD 7,509,583	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates ' Series 2009-12R 3A1 ' ' 144A ' 6.5% 27/10/2037	4,300,227	0.04
USD 2,066,956	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC ' Series 2007-CB6 A4 ' ' 144A ' FRN 25/7/2037	1,428,665	0.01
USD 373,129	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) ' Series 2006-CB2 AF4 ' 3.314% 25/12/2036	348,832	0.00
USD 3,754,931	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) ' Series 2006-SL1 A2 ' ' 144A ' 6.056% 25/9/2036	528,776	0.01
USD 705,000	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) ' Series 2006-MH1 B1 ' ' 144A ' 6.25% 25/10/2036	741,851	0.01
USD 362,000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4.75% 1/2/2026	375,266	0.00
USD 1,895,000	Crown Castle International Corp 3.1% 15/11/2029	1,970,228	0.02
USD 12,087,000	Crown Castle International Corp 3.65% 1/9/2027	13,080,310	0.12
USD 1,080,000	Crown Castle International Corp 4.3% 15/2/2029	1,220,921	0.01
USD 4,322,000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc ' 144A ' 5.625% 15/10/2025	4,224,798	0.04
USD 1,220,000	Csail 2015-C2 Commercial Mortgage Trust ' Series 2015- C2 B ' FRN 15/6/2057	1,273,958	0.01
USD 19,163,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust FRN 15/11/2027	313,621	0.00
USD 1,500,000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust ' Series 2018-CX12 A4 ' FRN 15/8/2051	1,742,403	0.02
USD 2,508,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 5.375% 15/7/2023	2,566,085	0.02
USD 742,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 5.375% 1/2/2028	781,788	0.01
USD 1,116,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 5.5% 15/5/2026	1,154,527	0.01
USD 553,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 5.5% 15/4/2027	584,438	0.01
USD 3,296,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 5.75% 15/1/2030	3,496,924	0.03
USD 675,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 6.5% 1/2/2029	748,828	0.01
USD 5,781,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 6.625% 15/10/2025	6,070,339	0.06
USD 7,683,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 10.875% 15/10/2025	8,447,343	0.08
USD 1,047,296	CSFB Mortgage-Backed Pass- Through Certificates Series 2005-10 ' Series 2005-10 10A1 ' FRN 25/11/2035	300,994	0.00
USD 122,260,000	CSMC 2014-USA OA LLC ' Series 2014-USA X2 ' ' 144A ' FRN 15/9/2037	528,163	0.01
USD 770,000	CSMC 2017-TIME ' Series 2017-TIME A ' ' 144A ' 3.646% 13/11/2039	861,176	0.01
USD 8,716,874	CSMC 2018-RPL8 Trust ' Series 2018-RPL8 A1 ' ' 144A ' FRN 25/7/2058	8,835,492	0.08
USD 2,082,533	CSMC Mortgage-Backed Trust 2007-5 ' Series 2007-5 1A11 ' FRN 25/8/2037	1,807,689	0.02
USD 1,728,759	CSMC Series 2009-5R ' Series 2009-5R 4A4 ' ' 144A ' FRN 25/6/2036	1,458,716	0.01
USD 2,950,672	CSMC Series 2014-11R ' Series 2014-11R 16A1 ' ' 144A ' FRN 27/9/2047	3,024,130	0.03
USD 799,458	CSMC Series 2014-4R ' Series 2014-4R 16A3 ' ' 144A ' FRN 27/2/2036	773,485	0.01
USD 1,343,411	CSMC Series 2014-9R ' Series 2014-9R 9A1 ' ' 144A ' FRN 27/8/2036	1,214,953	0.01
USD 1,650,000	CSMC Series 2015-4R ' Series 2015-4R 1A4 ' ' 144A ' FRN 27/10/2036	1,096,003	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 570,000	CSMC Series 2015-4R 'Series 2015-4R 1A2' '144A' FRN 27/11/2036	566,892	0.01
USD 56,488	CSMC Series 2015-6R 'Series 2015-6R 5A1' '144A' FRN 27/3/2036	56,536	0.00
USD 2,708,147	CSMC Series 2015-6R 'Series 2015-6R 5A2' '144A' FRN 27/3/2036	2,124,433	0.02
USD 879,000	CSMC Trust 2017-CHOP 'Series 2017-CHOP E' '144A' FRN 15/7/2032	879,976	0.01
USD 790,000	CSMC Trust 2017-PFHP 'Series 2017-PFHP A' '144A' FRN 15/12/2030	790,008	0.01
USD 530,000	Cumberland Park CLO Ltd 'Series 2015-2A CR' '144A' FRN 20/7/2028	528,034	0.01
USD 500,000	Cumberland Park CLO Ltd 'Series 2015-2A DR' '144A' FRN 20/7/2028	497,462	0.00
USD 507,586	Cutwater 2014-I Ltd 'Series 2014-1A A1AR' '144A' FRN 15/7/2026	507,694	0.01
USD 103,465	CVP Cascade CLO-1 Ltd 'Series 2013-CLO1 A1R' '144A' FRN 16/1/2026	103,436	0.00
USD 4,795,000	CVS Health Corp 4.1% 25/3/2025	5,229,174	0.05
USD 6,184,287	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 'Series 2005-16 1AF' FRN 25/4/2036	6,237,781	0.06
USD 1,202,647	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 'Series 2005-16 2AF3' FRN 25/5/2036	1,233,800	0.01
USD 5,108,896	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-17 (Step-up coupon) 'Series 2005-17 1AF4' 6.047% 25/5/2036	5,375,712	0.05
USD 189,414	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 'Series 2006-11 3AV2' FRN 25/9/2046	186,382	0.00
USD 6,030,202	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-18 'Series 2006-18 M1' FRN 25/3/2037	4,475,022	0.04
USD 674,178	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-U ' Series 2004-U 2A' FRN 15/3/2034	650,765	0.01
USD 468,939	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 'Series 2006- S5 A5' 6.155% 25/6/2035	521,869	0.01
USD 5,178,694	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 'Series 2006-RES 5B1A' '144A' FRN 15/5/2035	4,962,505	0.05
USD 184,307	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 'Series 2006-RES 5B1B' '144A' FRN 15/5/2035	177,323	0.00
USD 570,887	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-B ' Series 2005-B 2A' FRN 15/5/2035	557,675	0.01
USD 2,556,223	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-C ' Series 2006-C 2A' FRN 15/5/2036	2,521,417	0.02
USD 1,363,893	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H ' Series 2006-H 1A' FRN 15/11/2036	1,181,392	0.01
USD 1,460,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2041	1,769,491	0.02
USD 1,970,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2046	2,378,745	0.02
USD 1,530,000	Dallas/Fort Worth International Airport 3.144% 1/11/2045	1,675,312	0.02
USD 340,000	Dallas/Fort Worth International Airport 5% 1/11/2043	348,995	0.00
USD 572,000	Darling Ingredients Inc '144A' 5.25% 15/4/2027	603,433	0.01
USD 877,000	DaVita Inc 5% 1/5/2025	891,545	0.01
USD 4,600,000	DBJPM 17-C6 Mortgage Trust 'Series 2017-C6 XD' FRN 10/6/2050	270,434	0.00
USD 900,000	DBUBS 2011-LC1 Mortgage Trust 'Series 2011-LC1A E' '144A' ' FRN 10/11/2046	917,648	0.01
USD 1,080,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 'Series 2017-BRBK D' ' 144A' FRN 10/10/2034	1,132,271	0.01
USD 10,101,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 'Series 2017-BRBK E' ' 144A' FRN 10/10/2034	10,333,155	0.10
USD 2,570,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 'Series 2017-BRBK F' ' 144A' FRN 10/10/2034	2,590,907	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国 (続き)		
USD 204,000	DCP Midstream Operating LP 5.125% 15/5/2029	205,418	0.00
USD 5,733,000	DCP Midstream Operating LP ' 144A ' 5.35% 15/3/2020	5,740,281	0.05
USD 280,000	DCP Midstream Operating LP 5.375% 15/7/2025	298,757	0.00
USD 2,500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 ' Series 2017-1A A ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	2,500,123	0.02
USD 500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 ' Series 2017-1A E ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	477,986	0.00
USD 1,400,000	Del Amo Fashion Center Trust 2017-AMO ' Series 2017-AMO D ' ' 144A ' FRN 5/6/2035	1,414,221	0.01
USD 271,000	Dell International LLC / EMC Corp ' 144A ' 5.875% 15/6/2021	272,829	0.00
USD 75,000	Deutsche ALT-A Securities Inc ALT ' Series 2007-RS1 A2 ' ' 144A ' FRN 27/1/2037	72,678	0.00
USD 7,176,678	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4/DE ' Series 2007- OA4 A2A ' FRN 25/8/2047	5,154,797	0.05
USD 404,422	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 ' Series 2006-AB3 A3 ' FRN 25/7/2036	384,308	0.00
USD 258,148	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 ' Series 2006-AB3 A8 ' FRN 25/7/2036	245,336	0.00
USD 4,529,000	Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co ' 144A ' 5.375% 15/8/2026	4,339,353	0.04
USD 1,095,000	Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co ' 144A ' 6.625% 15/8/2027	921,826	0.01
USD 2,715,000	Diamondback Energy Inc 2.875% 1/12/2024	2,746,800	0.03
USD 9,656,000	Diamondback Energy Inc 3.25% 1/12/2026	9,832,224	0.09
USD 2,554,000	Diamondback Energy Inc 3.5% 1/12/2029	2,554,057	0.02
USD 19,668,000	Diamondback Energy Inc 5.375% 31/5/2025	20,508,382	0.20
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	1,128,897	0.01
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	1,126,147	0.01
USD 368,824	Dividend Solar Loans 2018-1 LLC ' Series 2018-1 B ' ' 144A ' 4.29% 20/7/2038	388,150	0.00
USD 1,507,000	Dorchester Park CLO DAC ' Series 2015-1A BR ' ' 144A ' FRN 20/4/2028	1,493,679	0.01
USD 640,000	Dorchester Park CLO DAC ' Series 2015-1A CR ' ' 144A ' FRN 20/4/2028	634,627	0.01
EUR 1,580,000	Dow Chemical Co/The 0.5% 15/3/2027	1,716,467	0.02
USD 11,181,000	Dryden 53 CLO Ltd ' Series 2017-53A A ' ' 144A ' FRN 15/1/2031	11,186,405	0.11
USD 500,000	Dryden XXV Senior Loan Fund ' Series 2012-25A CRR ' ' 144A ' FRN 15/10/2027	500,711	0.00
USD 530,000	Dryden XXVI Senior Loan Fund ' Series 2013-26A AR ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	528,917	0.01
USD 6,505,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund ' Series 2013-28A A1LR ' ' 144A ' FRN 15/8/2030	6,511,463	0.06
USD 1,070,000	DuBois Hospital Authority 5% 15/7/2043	1,296,530	0.01
USD 3,625,000	Dun & Bradstreet Corp/The ' 144A ' 10.25% 15/2/2027	4,110,931	0.04
USD 2,175,000	Dutchess County Local Development Corp 5% 1/7/2046	2,580,877	0.02
USD 1,000,000	Eaton Vance CLO 2018-1 Ltd ' Series 2018-1A C ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	999,902	0.01
USD 6,317,000	Elanco Animal Health Inc 4.662% 27/8/2021	6,605,731	0.06
USD 7,375,000	Elanco Animal Health Inc 5.022% 28/8/2023	7,945,544	0.08
USD 1,667,000	Elanco Animal Health Inc 5.65% 28/8/2028	1,923,531	0.02
USD 500,000	Elevation CLO 2014-3 Ltd ' Series 2014-3A DR ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	501,833	0.00
USD 1,577,000	Elevation CLO 2018-10 Ltd ' Series 2018-10A B ' ' 144A ' FRN 20/10/2031	1,577,763	0.02
USD 960,000	Eleven Madison Trust 2015- 11MD Mortgage Trust ' Series 2015-11MD A ' ' 144A ' FRN 10/9/2035	1,048,629	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 78,000	EMC Corp 2.65% 1/6/2020	77,877	0.00
EUR 1,160,000	Emerson Electric Co 0.375% 22/5/2024*	1,295,908	0.01
USD 560,000	Emerson Park CLO Ltd ' Series 2013-1A DR ' ' 144A ' FRN 15/7/2025	562,180	0.01
USD 2,297,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc ' 144A ' 5.5% 30/1/2026	2,302,335	0.02
USD 1,882,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc ' 144A ' 5.75% 30/1/2028	1,874,227	0.02
USD 11,093,000	Energen Corp 4.625% 1/9/2021	11,416,441	0.11
USD 255,000	ESH Hospitality Inc ' 144A ' 4.625% 1/10/2027	249,612	0.00
USD 3,080,000	ESH Hospitality Inc ' 144A ' 5.25% 1/5/2025	3,119,778	0.03
USD 773,563	Exantas Capital Corp 2018- RS06 Ltd ' Series 2018-RS06 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2035	772,150	0.01
EUR 1,660,000	Fidelity National Information Services Inc 0.625% 3/12/2025	1,848,874	0.02
GBP 1,655,000	Fidelity National Information Services Inc 2.602% 21/5/2025	2,251,035	0.02
EUR 345,000	Fidelity National Information Services Inc 2.95% 21/5/2039	458,975	0.00
GBP 960,000	Fidelity National Information Services Inc 3.36% 21/5/2031	1,398,723	0.01
USD 799,734	First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 ' Series 2004-FFH3 M3 ' FRN 25/10/2034	763,556	0.01
USD 1,788,221	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 ' Series 2006-FF13 A1 ' FRN 25/10/2036	1,442,310	0.01
USD 2,102,683	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FFH1 ' Series 2006-FFH1 M2 ' FRN 25/1/2036	1,475,523	0.01
GBP 920,000	Fiserv Inc 3% 1/7/2031	1,291,002	0.01
USD 8,348,000	Fiserv Inc 3.5% 1/7/2029	9,078,004	0.09
USD 7,694,000	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp ' 144A ' 7.875% 15/11/2025	7,829,030	0.07
USD 1,073,701	Flatiron CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A AR ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	1,072,287	0.01
USD 3,025,000	Flatiron CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A CR ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	3,009,248	0.03
USD 885,000	Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency 4.094% 15/1/2049	947,100	0.01
USD 4,792,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18/3/2024	5,158,525	0.05
USD 3,839,000	Forestar Group Inc ' 144A ' 5% 1/3/2028	3,774,217	0.04
USD 8,464,000	Forestar Group Inc ' 144A ' 8% 15/4/2024	9,144,633	0.09
USD 824,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/1/2025	897,899	0.01
USD 630,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/11/2026	697,883	0.01
USD 930,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/6/2028	1,063,181	0.01
USD 920,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 3.241% 25/9/2024	988,276	0.01
USD 187,246	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 3.413% 25/12/2026	208,493	0.00
USD 630,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 3.444% 25/12/2027	704,949	0.01
USD 1,560,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 3.9% 25/4/2028	1,810,691	0.02
USD 386,802	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2015-DN1 B ' FRN 25/1/2025	520,615	0.01
USD 411,088	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2015-HQ2 B ' FRN 25/5/2025	498,845	0.00
USD 1,165,455	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA2 B1 ' FRN 25/10/2029	1,372,538	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,538,279	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA3 B1 ' FRN 25/3/2030	1,743,870	0.02
USD 566,143	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-HRP1 M2 ' FRN 25/12/2042	566,879	0.01
USD 532,000	Freeport-McMoRan Inc 5% 1/9/2027	537,666	0.01
USD 532,000	Freeport-McMoRan Inc 5.25% 1/9/2029	543,651	0.01
USD 1,150,000	FREMF 2016-K54 Mortgage Trust ' Series 2016-K54 B ' ' 144A ' FRN 25/4/2048	1,247,423	0.01
USD 598,333	FREMF 2017-K64 Mortgage Trust ' Series 2017-K64 B ' ' 144A ' FRN 25/5/2050	656,679	0.01
USD 820,000	FREMF 2017-KGS1 Mortgage Trust ' Series 2017-KGX1 BFX ' ' 144A ' FRN 25/10/2027	841,603	0.01
USD 1,700,000	FREMF 2018-K732 Mortgage Trust FRN 25/5/2025	1,821,019	0.02
USD 390,000	FREMF 2018-K74 Mortgage Trust ' Series 2018-K74 B ' ' 144A ' FRN 25/2/2051	432,232	0.00
USD 700,000	FREMF 2018-K77 Mortgage Trust ' Series 2018-K77 B ' ' 144A ' FRN 25/5/2051	778,040	0.01
USD 9,153,281	Fremont Home Loan Trust 2006-3 ' Series 2006-3 1A1 ' FRN 25/2/2037	6,948,420	0.07
USD 2,089,470	FRESB 2018-SB52 Mortgage Trust ' Series 2018-SB52 A10F ' FRN 25/6/2028	2,252,795	0.02
USD 1,259,328	FRESB 2018-SB53 Mortgage Trust ' Series 2018-SB53 A10F ' FRN 25/6/2028	1,414,610	0.01
USD 4,608,000	Galaxy XXIII CLO Ltd ' Series 2017-23A A ' ' 144A ' FRN 24/4/2029	4,608,799	0.04
USD 250,000	Galaxy XXIX CLO Ltd ' Series 2018-29A B ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	249,770	0.00
USD 850,000	Galaxy XXIX CLO Ltd ' Series 2018-29A C ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	847,516	0.01
USD 2,130,000	Galaxy XXIX CLO Ltd ' Series 2018-29A D ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	2,126,161	0.02
USD 4,489,127	GAM Resecuritization Trust 2018-B FRN 27/1/2027	4,358,201	0.04
EUR 2,745,000	General Mills Inc 0.45% 15/1/2026	3,045,855	0.03
USD 2,269,000	George Washington University/ The 4.126% 15/9/2048	2,849,881	0.03
USD 272,422	GE-WMC Asset-Backed Pass- Through Certificates Series 2005-2 ' Series 2005-2 A2C ' FRN 25/12/2035	271,873	0.00
USD 3,949,069	GE-WMC Asset-Backed Pass- Through Certificates Series 2005-2 ' Series 2005-2 M1 ' FRN 25/12/2035	3,465,997	0.03
USD 2,090,000	Gilbert Park CLO Ltd ' Series 2017-1A C ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	2,068,957	0.02
USD 8,467,000	Gilbert Park CLO Ltd ' Series 2017-1A D ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	8,313,412	0.08
USD 617,771	Ginnie Mae II Pool ' MA5764 ' 4.5% 20/2/2049	650,933	0.01
USD 45,546,042	Ginnie Mae II Pool ' MA5818 ' 4.5% 20/3/2049	48,041,430	0.46
USD 45,056,615	Ginnie Mae II Pool ' MA5877 ' 4.5% 20/4/2049	47,438,481	0.45
USD 178,470	Ginnie Mae II Pool ' MA6041 ' 4.5% 20/7/2049	187,822	0.00
USD 904,000	Golden Entertainment Inc ' 144A ' 7.625% 15/4/2026	971,915	0.01
USD 2,080,000	Golden Nugget Inc ' 144A ' 6.75% 15/10/2024	2,110,139	0.02
USD 1,000,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 Ltd ' Series 2019- 5A A ' ' 144A ' FRN 20/10/2032	1,000,169	0.01
USD 720,000	Goldentree Loan Opportunities IX Ltd ' Series 2014-9A AR2 ' ' 144A ' FRN 29/10/2029	721,821	0.01
USD 1,416,000	Goldentree Loan Opportunities X Ltd ' Series 2015-10A AR ' ' 144A ' FRN 20/7/2031	1,415,106	0.01
USD 1,255,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd ' Series 2015-11A AR2 ' ' 144A ' FRN 18/1/2031	1,255,488	0.01
USD 2,580,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 Ltd ' Series 2017- 1A CR ' ' 144A ' FRN 20/4/2029	2,580,000	0.02
USD 3,000,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 Ltd ' Series 2017-1A DR ' ' 144A ' FRN 20/4/2029	3,000,000	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 750,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1/5/2029	844,817	0.01
USD 376,000	Goodyear Tire & Rubber Co/ The 5% 31/5/2026	374,007	0.00
USD 1,473,494	Government National Mortgage Association ' Series 2013-145 SI ' FRN 16/4/2040	72,231	0.00
USD 4,648,928	Government National Mortgage Association ' Series 2015-48 IO ' FRN 16/2/2050	190,673	0.00
USD 15,473,345	Government National Mortgage Association ' Series 2013-63 IO ' FRN 16/9/2051	781,443	0.01
USD 2,196,315	Government National Mortgage Association ' Series 2012-23 IO ' FRN 16/6/2053	30,197	0.00
USD 10,617,829	Government National Mortgage Association ' Series 2013-30 IO ' FRN 16/9/2053	389,598	0.00
USD 2,194,399	Government National Mortgage Association ' Series 2013-191 IO ' FRN 16/11/2053	67,530	0.00
USD 12,273,242	Government National Mortgage Association ' Series 2013-78 IO ' FRN 16/10/2054	479,920	0.00
USD 13,240,963	Government National Mortgage Association ' Series 2015-22 IO ' FRN 16/3/2055	527,155	0.01
USD 5,598,210	Government National Mortgage Association ' Series 2015-173 IO ' FRN 16/9/2055	350,376	0.00
USD 12,075,169	Government National Mortgage Association ' Series 2016-128 IO ' FRN 16/9/2056	884,518	0.01
USD 2,095,205	Government National Mortgage Association ' Series 2015-37 IO ' FRN 16/10/2056	111,003	0.00
USD 3,800,380	Government National Mortgage Association ' Series 2016-67 IO ' FRN 16/7/2057	275,469	0.00
USD 3,502,562	Government National Mortgage Association ' Series 2016-36 IO ' FRN 16/8/2057	233,509	0.00
USD 6,417,880	Government National Mortgage Association ' Series 2016-125 IO ' FRN 16/12/2057	461,093	0.00
USD 6,295,873	Government National Mortgage Association ' Series 2016-165 IO ' FRN 16/12/2057	443,036	0.00
USD 15,238,452	Government National Mortgage Association ' Series 2016-96 IO ' FRN 16/12/2057	1,108,514	0.01
USD 7,175,129	Government National Mortgage Association ' Series 2016-113 IO ' FRN 16/2/2058	598,073	0.01
USD 15,201,815	Government National Mortgage Association ' Series 2016-26 IO ' FRN 16/2/2058	906,741	0.01
USD 4,771,083	Government National Mortgage Association ' Series 2016-110 IO ' FRN 16/5/2058	335,886	0.00
USD 6,701,388	Government National Mortgage Association ' Series 2016-152 IO ' FRN 15/8/2058	463,843	0.00
USD 23,415,118	Government National Mortgage Association ' Series 2016-162 IO ' FRN 16/9/2058	1,837,265	0.02
USD 10,263,059	Government National Mortgage Association FRN 16/6/2060	580,753	0.01
USD 586,797	Government National Mortgage Association ' Series 2016-158 VA ' 2% 16/3/2035	582,334	0.01
USD 928,799	Government National Mortgage Association ' Series 2015-97 VA ' 2.25% 16/12/2038	941,088	0.01
USD 1,114,923	GPMT 2018-FL1 Ltd ' Series 2018-FL1 A ' ' 144A ' FRN 21/11/2035	1,116,316	0.01
USD 9,330,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ' Series 2014-GRCE E ' ' 144A ' FRN 10/6/2028	9,428,876	0.09
USD 8,844,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ' Series 2014-GRCE F ' ' 144A ' FRN 10/6/2028	8,915,896	0.08
USD 267,000	Gran Tierra Energy Inc ' 144A ' 7.75% 23/5/2027	243,971	0.00
USD 730,000	Grant County Public Utility District No 2 Priest Rapids Hydroelectric Project 4.584% 1/1/2040	949,931	0.01
USD 291,000	Gray Television Inc ' 144A ' 5.875% 15/7/2026	301,374	0.00
USD 500,000	Great Lakes Water Authority Water Supply System Revenue 5.25% 1/7/2033	621,240	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,515,000	Great Western Petroleum LLC / Great Western Finance Corp ' 144A ' 9% 30/9/2021	4,076,594	0.04
USD 1,020,000	Greenpoint Manufactured Housing ' Series 1999-5 M1B ' FRN 15/12/2029	1,098,357	0.01
USD 1,091,218	Greenpoint Manufactured Housing ' Series 1999-5 M2 ' FRN 15/12/2029	951,472	0.01
USD 1,609,422	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 ' Series 2006- AR2 4A1 ' FRN 25/3/2036	1,614,471	0.02
USD 370,000	Grippen Park Clo Ltd ' Series 2017-1A A ' ' 144A ' FRN 20/1/2030	370,396	0.00
USD 750,000	GS Mortgage Securities Corp II ' Series 2012-TMSQ D ' ' 144A ' FRN 10/12/2030	767,229	0.01
USD 440,000	GS Mortgage Securities Corp II ' Series 2017-375H A ' ' 144A ' FRN 10/9/2037	486,347	0.00
USD 25,000,000	GS Mortgage Securities Corp II Series 2005-ROCK ' Series 2005-ROCK X1 ' ' 144A ' FRN 3/5/2032	337,408	0.00
USD 2,570,000	GS Mortgage Securities Corp II Series 2005-ROCK ' Series 2005-ROCK A ' ' 144A ' 5.366% 3/5/2032	2,993,624	0.03
USD 1,055,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2016-RENT ' Series 2016- RENT C ' ' 144A ' FRN 10/2/2029	1,067,548	0.01
USD 1,450,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017- 500K D ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	1,453,270	0.01
USD 2,000,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017- 500K E ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	2,002,176	0.02
USD 1,119,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017- 500K F ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	1,120,993	0.01
USD 675,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017- 500K G ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	677,082	0.01
USD 2,170,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-GPTX ' Series 2017- GPTX A ' ' 144A ' 2.856% 10/5/2034	2,189,310	0.02
USD 1,085,218	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-HULA ' Series 2018- HULA D ' ' 144A ' FRN 15/7/2025	1,084,442	0.01
USD 110,000	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 ' Series 2014- GC20 B ' FRN 10/4/2047	119,289	0.00
USD 1,112,368	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 ' Series 2014- GC20 XA ' FRN 10/4/2047	32,760	0.00
USD 1,200,000	GS Mortgage Securities Trust 2015-590M ' Series 2015- 590M E ' ' 144A ' FRN 10/10/2035	1,231,614	0.01
USD 450,000	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28 ' Series 2015- GC28 B ' 3.98% 10/2/2048	483,085	0.00
USD 1,129,000	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 ' Series 2017-GS7 D ' ' 144A ' 3% 10/8/2050	1,106,784	0.01
USD 780,000	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 ' Series 2017-GS7 E ' ' 144A ' 3% 10/8/2050	748,440	0.01
USD 1,828,767	GSAA Home Equity Trust 2006- 4 ' Series 2006-4 1A1 ' FRN 25/3/2036	1,587,694	0.02
USD 12,380,297	GSAA Home Equity Trust 2006- 5 ' Series 2006-5 1A1 ' FRN 25/3/2036	5,940,729	0.06
USD 470,980	GSAA Home Equity Trust 2007- 2 ' Series 2007-2 AF3 ' FRN 25/3/2037	153,848	0.00
USD 3,730,189	GSAMP Trust 2006-FM3 ' Series 2006-FM3 A1 ' FRN 25/11/2036	2,341,561	0.02
USD 1,174,325	GSAMP Trust 2007-H1 ' Series 2007-H1 A1B ' FRN 25/1/2047	744,249	0.01
USD 2,000,000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 ' Series 2007-HS1 M6 ' FRN 25/2/2047	2,098,511	0.02
USD 1,171,288	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP1 ' Series 2005-RP1 1AF ' ' 144A ' FRN 25/1/2035	1,056,872	0.01
USD 1,396,360	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP2 ' Series 2005-RP2 1AF ' ' 144A ' FRN 25/3/2035	1,309,935	0.01
USD 1,094,680	GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1 ' Series 2006-RP1 1AF1 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	955,682	0.01
USD 2,245,726	GSR Mortgage Loan Trust 2006-7F ' Series 2006-7F 4A2 ' 6.5% 25/8/2036	1,335,930	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 12,658,130	GSR Mortgage Loan Trust 2006-0A1 ' Series 2006-0A1 1A1 ' FRN 25/8/2046	4,918,728	0.05
USD 1,913,756	GSR Mortgage Loan Trust 2007-1F ' Series 2007-1F 2A4 ' 5.5% 25/1/2037	2,168,064	0.02
USD 5,252,805	GSR Mortgage Loan Trust 2007-0A2 ' Series 2007-0A2 2A1 ' FRN 25/6/2047	4,131,444	0.04
USD 1,413,000	H&E Equipment Services Inc 5.625% 1/9/2025	1,466,150	0.01
USD 250,000	Halcyon Loan Advisors Funding 2013-2 Ltd ' Series 2013-2A C ' ' 144A ' FRN 1/8/2025	250,747	0.00
USD 680,000	Halcyon Loan Advisors Funding 2014-3 Ltd ' Series 2014-3A B1R ' ' 144A ' FRN 22/10/2025	681,283	0.01
USD 1,513,926	Halcyon Loan Advisors Funding 2015-2 Ltd ' Series 2015-2A AR ' ' 144A ' FRN 25/7/2027	1,511,711	0.01
USD 1,024,000	Hanesbrands Inc ' 144A ' 4.625% 15/5/2024	1,072,215	0.01
USD 306,000	Hanesbrands Inc ' 144A ' 4.875% 15/5/2026	321,291	0.00
USD 18,564,102	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-12 ' Series 2006- 12 1A1A ' FRN 19/12/2036	16,699,475	0.16
USD 684,277	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-4 ' Series 2007-4 2A2 ' FRN 19/7/2047	639,177	0.01
USD 685,000	HCA Healthcare Inc 6.25% 15/2/2021	712,691	0.01
USD 16,120,000	HCA Inc 3.5% 1/9/2030	15,764,527	0.15
USD 4,581,000	HCA Inc 4.125% 15/6/2029	4,986,009	0.05
USD 2,140,000	HCA Inc 5.25% 15/6/2026	2,440,157	0.02
USD 1,784,000	HCA Inc 5.375% 1/2/2025	1,974,148	0.02
USD 1,069,000	HCA Inc 5.375% 1/9/2026	1,188,755	0.01
USD 510,000	HCA Inc 5.625% 1/9/2028	580,814	0.01
USD 1,030,000	HCA Inc 5.875% 15/2/2026	1,165,291	0.01
USD 761,000	HCA Inc 5.875% 1/2/2029	881,428	0.01
USD 452,000	HD Supply Inc ' 144A ' 5.375% 15/10/2026	472,420	0.00
USD 785,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 15/11/2029	964,938	0.01
USD 335,000	Hertz Corp/The ' 144A ' 5.5% 15/10/2024	323,203	0.00
USD 210,000	Hertz Corp/The ' 144A ' 7.125% 1/8/2026	210,919	0.00
USD 1,450,000	Hess Corp 5.6% 15/2/2041	1,595,687	0.02
USD 320,000	Highbridge Loan Management 12-2018 Ltd ' Series 12A-18 A1B ' ' 144A ' FRN 18/7/2031	320,367	0.00
USD 650,000	Highbridge Loan Management 12-2018 Ltd ' Series 12A-18 D ' ' 144A ' FRN 18/7/2031	599,249	0.01
USD 2,830,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd ' Series 6A-2015 A1R ' ' 144A ' FRN 5/2/2031	2,818,760	0.03
USD 330,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd ' Series 7A-2015 CR ' ' 144A ' FRN 15/3/2027	327,311	0.00
USD 340,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd ' Series 7A-2015 DR ' ' 144A ' FRN 15/3/2027	336,233	0.00
USD 345,000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.25% 1/9/2024	348,490	0.00
USD 753,000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15/1/2030	783,254	0.01
USD 377,000	Hilton Domestic Operating Co Inc 5.125% 1/5/2026	391,269	0.00
USD 3,747,000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.625% 1/4/2025	3,806,521	0.04
USD 891,000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 1/4/2027	923,682	0.01
USD 329,000	Hologic Inc ' 144A ' 4.375% 15/10/2025	337,154	0.00
USD 1,980,000	Home Equity Asset Trust 2007-1 ' Series 2007-1 2A3 ' FRN 25/5/2037	1,673,833	0.02
USD 9,002,772	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2006-E ' Series 2006- E 2A3 ' FRN 25/4/2037	6,653,595	0.06

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,849,432	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A ' Series 2007-A 2A2 ' FRN 25/4/2037	1,361,367	0.01
USD 9,044,967	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A ' Series 2007-A 2A3 ' FRN 25/4/2037	6,709,125	0.06
USD 515,188	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A ' Series 2004-A M2 ' FRN 25/7/2034	519,956	0.01
USD 2,869,583	Home Equity Mortgage Trust 2006-2 (Step-up coupon) ' Series 2006-2 1A1 ' 5.867% 25/7/2036	823,357	0.01
USD 1,081,837	Home Loan Mortgage Loan Trust 2005-1 ' Series 2005-1 A3 ' FRN 15/4/2036	1,004,064	0.01
USD 532,000	Horizon Therapeutics USA Inc ' 144A ' 5.5% 1/8/2027	559,701	0.01
USD 590,000	Howard Hughes Corp/The ' 144A ' 5.375% 15/3/2025	606,042	0.01
USD 1,630,000	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust ' Series 2016- 10HY A ' ' 144A ' 2.835% 10/8/2038	1,722,992	0.02
USD 6,957,000	Hyundai Capital America ' 144A ' 3.4% 20/6/2024	7,280,153	0.07
USD 2,450,000	ICG US CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A A1R ' ' 144A ' FRN 19/10/2028	2,451,464	0.02
USD 970,000	Idaho Health Facilities Authority 5% 1/12/2047	1,203,741	0.01
USD 170,000	iHeartCommunications Inc ' 144A ' 4.75% 15/1/2028	170,688	0.00
USD 855,000	iHeartCommunications Inc ' 144A ' 5.25% 15/8/2027	879,838	0.01
USD 924,992	iHeartCommunications Inc 6.375% 1/5/2026	992,354	0.01
USD 1,210,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017-APTS AFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	1,284,295	0.01
USD 2,798,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017-APTS BFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	2,948,581	0.03
USD 5,890,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017-APTS DFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	6,085,917	0.06
USD 2,000,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017-APTS EFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	2,029,724	0.02
USD 2,610,000	Indiana Finance Authority 5% 1/10/2045	3,027,992	0.03
USD 740,000	Indiana Housing & Community Development Authority 3.8% 1/7/2038	824,686	0.01
USD 4,390,179	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust 2007-HOA1 ' Series 2007-HOA1 AXPP ' FRN 25/7/2047	218,526	0.00
USD 785,312	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 ' Series 2006-AR15 A1 ' FRN 25/7/2036	738,548	0.01
USD 7,485,481	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR19 ' Series 2007-AR19 3A1 ' FRN 25/9/2037	5,348,420	0.05
USD 919,656	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 ' Series 2007-FLX5 2A2 ' FRN 25/8/2037	827,954	0.01
EUR 3,015,000	International Business Machines Corp 0.875% 31/1/2025*	3,445,924	0.03
USD 1,450,000	International Business Machines Corp 4% 20/6/2042	1,709,452	0.02
USD 5,480,000	International Business Machines Corp 4.25% 15/5/2049	6,728,745	0.06
USD 1,915,882	Invitation Homes 2018-SFR1 Trust ' Series 2018-SFR1 E ' ' 144A ' FRN 17/3/2037	1,920,500	0.02
USD 2,543,646	Invitation Homes 2018-SFR3 Trust ' Series 2018-SFR3 A ' ' 144A ' FRN 17/7/2037	2,551,012	0.02
USD 2,256,127	Invitation Homes 2018-SFR3 Trust ' Series 2018-SFR3 E ' ' 144A ' FRN 17/7/2037	2,271,740	0.02
EUR 2,250,000	IQVIA Inc 3.25% 15/3/2025	2,498,860	0.02
USD 1,197,000	IQVIA Inc ' 144A ' 5% 15/10/2026	1,248,085	0.01
USD 1,256,000	IQVIA Inc ' 144A ' 5% 15/5/2027	1,311,933	0.01
EUR 2,138,000	Iron Mountain Inc 3% 15/1/2025*	2,377,392	0.02
USD 1,135,000	Iron Mountain US Holdings Inc ' 144A ' 5.375% 1/6/2026	1,183,632	0.01
USD 946,089	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-3 (Step-up coupon) ' Series 2006-3 2A3 ' ' 144A ' 6.53% 25/9/2037	951,251	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 230,809	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-P1 'Series 2006-P1 1A' '144A' FRN 25/12/2036	223,264	0.00
USD 11,193,555	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 'Series 2007-HE1 A4' FRN 25/5/2037	4,087,487	0.04
USD 7,280,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE 'Series 2016- NINE A' '144A' FRN 6/9/2038	7,728,812	0.07
USD 3,539,000	Jagged Peak Energy LLC 5.875% 1/5/2026	3,537,487	0.03
USD 624,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc '144A' 5.75% 15/6/2025	646,838	0.01
USD 655,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc '144A' 5.875% 15/7/2024	668,427	0.01
USD 1,352,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc '144A' 6.75% 15/2/2028	1,466,244	0.01
USD 2,605,000	JobsOhio Beverage System 3.985% 1/1/2029	2,929,830	0.03
USD 362,811	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 'Series 2007- A2 2A1' FRN 25/5/2037	334,912	0.00
USD 1,500,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp ' Series 2017-FL10 E' '144A' FRN 15/6/2032	1,511,048	0.01
USD 1,700,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp ' Series 2017-FL10 F' '144A' FRN 15/6/2032	1,688,483	0.02
USD 1,490,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1 'Series 2015-JP1 C' FRN 15/1/2049	1,619,408	0.02
USD 2,230,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1 'Series 2015-JP1 D' FRN 15/1/2049	2,336,185	0.02
USD 3,100,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JES 'Series 2015-JES D' '144A' FRN 5/9/2032	3,104,796	0.03
USD 4,957,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JES 'Series 2015-JES E' '144A' FRN 5/9/2032	4,964,669	0.05
USD 230,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JES 'Series 2015-JES F' '144A' FRN 5/9/2032	230,138	0.00
USD 10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-JP3 'Series 2016-JP3 XC' '144A' FRN 15/8/2049	454,430	0.00
USD 1,090,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT 'Series 2018-WPT FFX' '144A' 5.542% 5/7/2033	1,141,543	0.01
USD 788,457	JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series 2014-1 ' Series 2014-CH1 M2' '144A' FRN 25/11/2024	869,871	0.01
USD 960,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CW1 'Series 2006-CW1 M1' FRN 25/5/2036	929,355	0.01
USD 10,376,382	JP Morgan Mortgage Trust 2017-3 'Series 2017-3 1A6' '144A' ' FRN 25/8/2047	10,564,454	0.10
USD 1,295,683	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C22 ' Series 2014-C22 XA' FRN 15/9/2047	41,846	0.00
USD 1,046,641	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 ' Series 2014-C23 XA' FRN 15/9/2047	25,597	0.00
USD 1,500,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C27 ' Series 2015-C27 C' FRN 15/2/2048	1,580,047	0.02
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C27 ' Series 2015-C27 XD' '144A' FRN 15/2/2048	150,909	0.00
USD 2,036,703	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C29 ' Series 2015-C29 XA' FRN 15/5/2048	49,979	0.00
USD 1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C33 ' Series 2015-C33 D1' '144A' FRN 15/12/2048	1,513,352	0.01
USD 930,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP5 ' Series 2017-JP5 C' FRN 15/3/2050	986,180	0.01
USD 1,340,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP5 ' Series 2017-JP5 D' '144A' FRN 15/3/2050	1,435,809	0.01
USD 4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2016-C4 ' Series 2016-C4 XC' '144A' FRN 15/12/2049	184,339	0.00
USD 4,096,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/5/2020 (Perpetual)	4,103,025	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,110,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/5/2023 (Perpetual)	1,132,744	0.01
USD 2,921,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/2/2024 (Perpetual)	3,269,490	0.03
USD 9,575,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/8/2024 (Perpetual)	9,879,533	0.09
USD 8,539,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/2/2025 (Perpetual)	8,639,333	0.08
USD 391,000	KAR Auction Services Inc ' 144A ' 5.125% 1/6/2025	403,545	0.00
USD 1,362,000	KB Home 7.625% 15/5/2023	1,526,005	0.01
USD 802,000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC ' 144A ' 5.25% 1/6/2026	830,170	0.01
USD 2,512,000	KLA Corp 3.3% 1/3/2050	2,475,712	0.02
EUR 300,000	Kraft Heinz Foods Co 2.25% 25/5/2028	339,218	0.00
USD 204,000	Lamar Media Corp ' 144A ' 3.75% 15/2/2028	203,262	0.00
USD 744,000	Lamar Media Corp 5.75% 1/2/2026	780,813	0.01
USD 1,237,000	Lamb Weston Holdings Inc ' 144A ' 4.625% 1/11/2024	1,290,012	0.01
USD 1,238,000	Lamb Weston Holdings Inc ' 144A ' 4.875% 1/11/2026	1,289,971	0.01
USD 4,030,000	LCCM 2014-909 Mortgage Trust ' Series 2014-909 E ' ' 144A ' FRN 15/5/2031	4,066,111	0.04
USD 4,770,000	LCM 26 Ltd ' 144A ' FRN 20/1/2031	4,757,183	0.05
USD 1,000,000	LCM XX LP ' 144A ' FRN 20/10/2027	1,001,056	0.01
USD 1,330,000	LCM XXI LP ' 144A ' FRN 20/4/2028	1,330,039	0.01
USD 400,000	LCM XXIV Ltd ' 144A ' FRN 20/3/2030	400,310	0.00
USD 316,993	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2002-A ' Series 2002-A C ' 15/6/2033 (Zero Coupon)	283,230	0.00
USD 370,892	Lehman ABS Mortgage Loan Trust ' Series 2007-1 2A1 ' ' 144A ' FRN 25/6/2037	277,834	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers Holdings Inc 31/12/2049 (Zero Coupon)	22	0.00
USD 456,211	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 ' Series 2006-2A M2 ' ' 144A ' FRN 25/9/2036	448,043	0.00
USD 741,344	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 ' Series 2007-1A 1A ' ' 144A ' FRN 25/3/2037	699,810	0.01
USD 921,543	Lehman XS Trust Series 2007- 20N ' Series 2007-20N A1 ' FRN 25/12/2037	915,258	0.01
USD 6,757,000	Lendmark Funding Trust 2018-1 ' Series 2018-1A A ' ' 144A ' 3.81% 21/12/2026	6,921,272	0.07
USD 2,700,000	Lendmark Funding Trust 2018-1 ' Series 2018-1A C ' ' 144A ' 5.03% 21/12/2026	2,796,100	0.03
USD 16,000,000	Lendmark Funding Trust 2018-2 ' Series 2018-2A A ' ' 144A ' 4.23% 20/4/2027	16,686,988	0.16
USD 2,000,000	Lendmark Funding Trust 2018-2 ' Series 2018-2A C ' ' 144A ' 5.26% 20/4/2027	2,103,782	0.02
USD 18,000	Lennar Corp 2.95% 29/11/2020	18,052	0.00
USD 1,042,000	Lennar Corp 4.125% 15/1/2022	1,070,009	0.01
USD 392,000	Lennar Corp 4.5% 30/4/2024	421,041	0.00
USD 1,087,000	Lennar Corp 4.75% 1/4/2021	1,103,131	0.01
USD 10,973,000	Lennar Corp 4.75% 15/11/2022	11,530,428	0.11
USD 343,000	Lennar Corp 4.75% 30/5/2025	370,984	0.00
USD 617,000	Lennar Corp 4.75% 29/11/2027	681,075	0.01
USD 1,030,000	Lennar Corp 4.875% 15/12/2023	1,108,965	0.01
USD 60,000	Lennar Corp 5.25% 1/6/2026	66,921	0.00
USD 3,962,000	Lennar Corp 5.875% 15/11/2024	4,454,695	0.04
USD 340,000	Level 3 Financing Inc ' 144A ' 4.625% 15/9/2027	349,129	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 170,000	Level 3 Financing Inc 5.125% 1/5/2023	170,779	0.00
USD 1,470,000	Level 3 Financing Inc 5.25% 15/3/2026	1,519,760	0.01
USD 840,000	Lexington County Health Services District Inc 5% 1/11/2041	994,972	0.01
USD 2,746,702	LFRF ' 2015-1 ' ' 144A ' 4% 30/10/2027	2,738,019	0.03
USD 822,000	LGI Homes Inc ' 144A ' 6.875% 15/7/2026	861,396	0.01
USD 837,768	Limerock CLO III LLC ' Series 2014-3A A1R ' ' 144A ' FRN 20/10/2026	837,846	0.01
USD 2,165,000	Limerock CLO III LLC ' Series 2014-3A C ' ' 144A ' FRN 20/10/2026	2,168,919	0.02
USD 2,360,000	LoanCore 2018-CRE1 Issuer Ltd ' Series 2018-CRE1 A ' ' 144A ' FRN 15/5/2028	2,363,599	0.02
USD 343,543	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 ' Series 2006- 10 2A2 ' FRN 25/11/2036	162,376	0.00
USD 3,533,384	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 ' Series 2006- 10 2A3 ' FRN 25/11/2036	1,690,778	0.02
USD 1,256,958	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 ' Series 2006-10 2A4 ' FRN 25/11/2036	610,316	0.01
USD 5,291,421	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-2 ' Series 2006-2 1A ' FRN 25/3/2046	4,320,746	0.04
USD 10,741,836	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-4 ' Series 2006-4 2A3 ' FRN 25/5/2036	5,002,546	0.05
USD 3,432,248	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 ' Series 2006-5 2A3 ' FRN 25/6/2036	2,025,661	0.02
USD 886,070	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-6 ' Series 2006-6 2A3 ' FRN 25/7/2036	449,794	0.00
USD 5,585,688	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 ' Series 2006-7 2A3 ' FRN 25/8/2036	3,116,028	0.03
USD 1,291,617	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 ' Series 2006-9 2A2 ' FRN 25/10/2036	563,124	0.01
USD 4,960,749	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 ' Series 2006-9 2A3 ' FRN 25/10/2036	2,193,460	0.02
USD 1,571,900	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 ' Series 2006-9 2A4 ' FRN 25/10/2036	708,597	0.01
USD 5,000,000	Los Angeles Department of Water 5% 1/7/2043	5,477,425	0.05
USD 1,030,000	Louisiana Public Facilities Authority 5% 1/7/2048	1,279,996	0.01
USD 3,000,000	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2015-3 ' Series 2015-3 AS ' ' 144A ' FRN 20/4/2048	3,097,918	0.03
USD 2,441,933	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 ' Series 2017-5 X ' ' 144A ' FRN 10/3/2050	98,072	0.00
USD 3,192,000	M/I Homes Inc ' 144A ' 4.95% 1/2/2028	3,274,354	0.03
USD 4,200,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M ' Series 2017-330M D ' ' 144A ' FRN 15/8/2034	4,363,922	0.04
USD 6,600,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M ' Series 2017-330M E ' ' 144A ' FRN 15/8/2034	6,833,211	0.07
USD 1,149,747	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 2002-A ' Series 2002-A B2 ' FRN 25/3/2032	1,170,051	0.01
USD 6,600,000	Madison Avenue Trust 2013-650M ' Series 2013-650M D ' ' 144A ' FRN 12/10/2032	6,639,010	0.06
USD 4,225,000	Madison Park Funding XI Ltd ' Series 2013-11A AR ' ' 144A ' FRN 23/7/2029	4,229,137	0.04
USD 4,930,000	Madison Park Funding XIII Ltd ' Series 2014-13A AR2 ' ' 144A ' FRN 19/4/2030	4,938,560	0.05
USD 600,000	Madison Park Funding XIII Ltd ' Series 2014-13A CR2 ' ' 144A ' FRN 19/4/2030	600,591	0.01
USD 340,000	Madison Park Funding XV Ltd ' Series 2014-15A CR ' ' 144A ' FRN 27/1/2026	340,380	0.00
USD 1,140,749	Madison Park Funding XVI Ltd ' Series 2015-16A A1R ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	1,143,045	0.01
USD 500,000	Madison Park Funding XVI Ltd ' Series 2015-16A A2R ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	500,128	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 550,000	Madison Park Funding XVI Ltd ' Series 2015-16A C ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	551,073	0.01
USD 1,220,000	Madison Park Funding XVI Ltd ' Series 2015-16A D ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	1,208,079	0.01
USD 1,000,000	Madison Park Funding XVII Ltd ' Series 2015-17A B1R ' ' 144A ' FRN 21/7/2030	1,000,190	0.01
USD 5,430,000	Madison Park Funding XVIII Ltd ' Series 2015-18A A1R ' ' 144A ' FRN 21/10/2030	5,435,324	0.05
USD 700,000	Madison Park Funding XXX Ltd ' Series 2018-30A E ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	681,049	0.01
USD 120,610	Marathon CLO VII Ltd ' Series 2014-7A A1R ' ' 144A ' FRN 28/10/2025	120,715	0.00
USD 4,370,000	Marathon Oil Corp 4.4% 15/7/2027	4,742,267	0.05
USD 4,000,000	Mariner CLO 2015-1 LLC ' Series 2015-1A CR ' ' 144A ' FRN 20/4/2029	3,978,725	0.04
USD 690,000	Mariner Clo 2017-4 Ltd ' Series 2017-4A A ' ' 144A ' FRN 26/10/2029	690,867	0.01
USD 1,981,000	Marriott Ownership Resorts Inc / ILG LLC 6.5% 15/9/2026	2,118,430	0.02
EUR 2,235,000	Marsh & McLennan Cos Inc 1.349% 21/9/2026	2,594,471	0.02
USD 5,185,000	Marsh & McLennan Cos Inc 4.375% 15/3/2029	6,047,997	0.06
USD 1,290,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5% 15/8/2025	1,538,899	0.01
USD 820,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5% 15/8/2027	973,315	0.01
USD 835,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5.25% 1/7/2027	986,582	0.01
USD 810,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2043	1,000,548	0.01
USD 2,785,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2044	3,361,258	0.03
USD 1,040,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2047	1,250,995	0.01
USD 2,600,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2048	3,187,002	0.03
USD 500,000	Massachusetts Educational Financing Authority 5% 1/1/2022	535,970	0.01
USD 850,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2039	900,018	0.01
USD 1,060,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2048	1,158,516	0.01
USD 895,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.6% 1/12/2044	950,038	0.01
USD 4,295,000	Massachusetts School Building Authority 2.866% 15/10/2031	4,627,326	0.04
USD 2,665,000	Massachusetts School Building Authority 2.966% 15/10/2032	2,881,758	0.03
USD 870,000	Massachusetts Water Resources Authority 5% 1/8/2040	1,077,721	0.01
USD 1,401,845	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE1 ' Series 2007-HE1 A4 ' FRN 25/5/2037	1,248,123	0.01
USD 557,668	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 ' Series 2008-3 A1 ' ' 144A ' FRN 25/8/2037	379,459	0.00
USD 508,989	Mastr Specialized Loan Trust ' Series 2006-3 A ' ' 144A ' FRN 25/6/2046	489,090	0.00
USD 357,000	Matador Resources Co 5.875% 15/9/2026	316,829	0.00
USD 4,552,000	Mauser Packaging Solutions Holding Co ' 144A ' 5.5% 15/4/2024	4,576,171	0.04
USD 4,380,000	McDonald ' s Corp 3.625% 1/5/2043	4,593,100	0.04
USD 3,908,351	MCM Trust 2018-NPL1 ' Series 2018-NPL1 A ' ' 144A ' 4% 28/5/2058	3,920,459	0.04
USD 4,342,822	MCM Trust 2018-NPL2 (Stepup coupon) ' Series 2018-NPL2 A ' ' 144A ' 4% 25/10/2028	4,385,065	0.04
USD 3,074,000	Meritor Inc 6.25% 15/2/2024	3,129,071	0.03
USD 2,023,214	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series 2007-OAR2 ' Series 2007-OAR2 A2 ' FRN 25/4/2037	1,782,246	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD	5,798,342 Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 ' Series 2007-2 A2C ' FRN 25/5/2037	3,385,866	0.03
USD	901,019 Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-RM3 ' Series 2006-RM3 A2B ' FRN 25/6/2037	268,968	0.00
USD	88,179 Merrill Lynch Mortgage Trust 2005-CIP1 ' Series 2005-CIP1 D ' FRN 12/7/2038	89,484	0.00
USD	1,380,000 Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 5% 1/7/2041	1,653,109	0.02
USD	770,000 Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 5% 1/7/2040	923,026	0.01
USD	1,400,000 Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 5% 1/7/2046	1,658,496	0.02
GBP	1,145,000 Metropolitan Life Global Funding I 3.5% 30/9/2026	1,686,436	0.02
USD	1,150,000 Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2041	1,492,510	0.01
USD	2,950,000 Metropolitan Washington Airports Authority 5% 1/10/2048	3,667,484	0.04
USD	1,000,000 Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 5% 1/10/2053	1,072,490	0.01
USD	1,280,000 Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 7.462% 1/10/2046	2,255,264	0.02
USD	548,000 MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4.5% 1/9/2026	571,193	0.01
USD	9,846,000 MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 1/5/2024	10,728,054	0.10
USD	829,000 MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.75% 1/2/2027	920,978	0.01
USD	373,000 MGM Resorts International (Restricted) 4.625% 1/9/2026	390,784	0.00
USD	340,000 MGM Resorts International (Restricted) 5.5% 15/4/2027	374,629	0.00
USD	758,000 MGM Resorts International (Restricted) 5.75% 15/6/2025	841,372	0.01
USD	2,745,000 Michigan Finance Authority 3.384% 1/12/2040	3,035,846	0.03
USD	860,000 Michigan Finance Authority 5% 15/11/2028	1,076,742	0.01
USD	880,000 Michigan Finance Authority 5% 1/6/2039	999,486	0.01
USD	700,000 Michigan Finance Authority 5% 15/11/2041	849,537	0.01
USD	100,000 Michigan Finance Authority 5% 1/12/2047	111,244	0.00
USD	4,000,000 Microchip Technology Inc 3.922% 1/6/2021	4,108,632	0.04
USD	1,330,000 Mississippi Hospital Equipment & Facilities Authority 5% 1/9/2046	1,563,681	0.02
EUR	4,400,000 MMS USA Investments Inc 0.625% 13/6/2025	4,862,435	0.05
USD	417,000 Molina Healthcare Inc 5.375% 15/11/2022	435,590	0.00
USD	1,728,000 Montefiore Obligated Group 5.246% 1/11/2048	2,113,632	0.02
USD	1,479,000 Morgan Stanley FRN 15/7/2020 (Perpetual)	1,492,415	0.01
USD	2,022,000 Morgan Stanley FRN 22/7/2025	2,091,807	0.02
EUR	1,655,000 Morgan Stanley FRN 23/10/2026	1,902,442	0.02
USD	10,315,000 Morgan Stanley FRN 23/1/2030*	11,953,929	0.11
USD	2,996,123 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-HE5 ' Series 2005-HE5 M4 ' FRN 25/9/2035	1,793,419	0.02
USD	10,591,746 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2007-NC1 ' Series 2007-NC1 A1 ' FRN 25/11/2036	6,307,717	0.06
USD	11,026,000 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 ' Series 2014-C19 XD ' ' 144A ' FRN 15/12/2047	584,836	0.01
USD	3,830,000 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 ' Series 2014-C19 XF ' ' 144A ' FRN 15/12/2047	186,100	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	3,510,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 ' Series 2015-C21 XB ' ' 144A ' FRN 15/3/2048	54,609	0.00
USD	1,704,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 ' Series 2015-C23 D ' ' 144A ' FRN 15/7/2050	1,727,358	0.02
USD	220,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 ' Series 2015-C25 C ' FRN 15/10/2048	241,929	0.00
USD	5,350,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 ' Series 2015-C26 XD ' ' 144A ' FRN 15/10/2048	372,842	0.00
USD	503,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 ' Series 2015-C26 D ' ' 144A ' 3.06% 15/10/2048	493,030	0.00
USD	659,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 ' Series 2016-C32 A4 ' 3.72% 15/12/2049	735,843	0.01
USD	660,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C33 ' Series 2017-C33 C ' FRN 15/5/2050	719,409	0.01
USD	780,000	Morgan Stanley Capital Barclays Bank Trust 2016-MART ' Series 2016-MART A ' ' 144A ' 2.2% 13/9/2031	783,740	0.01
USD	380,000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 ' Series 2017-HR2 D ' 2.73% 15/12/2050	357,579	0.00
USD	1,460,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2006-IQ11 ' Series 2006-IQ11 C ' FRN 15/10/2042	1,493,763	0.01
USD	456,444	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-TOP27 ' Series 2007-T27 AJ ' FRN 11/6/2042	483,775	0.00
USD	2,080,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E ' Series 2014-150E F ' ' 144A ' FRN 9/9/2032	2,181,823	0.02
USD	200,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT ' Series 2014-CPT E ' ' 144A ' FRN 13/7/2029	204,353	0.00
USD	5,000,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT ' Series 2014-CPT F ' ' 144A ' FRN 13/7/2029	5,108,815	0.05
USD	1,875,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT ' Series 2014-CPT G ' ' 144A ' FRN 13/7/2029	1,915,806	0.02
USD	360,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 ' Series 2015-MS1 C ' FRN 15/5/2048	380,463	0.00
USD	250,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 ' Series 2015-MS1 D ' ' 144A ' FRN 15/5/2048	246,851	0.00
USD	5,480,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS ' Series 2017-CLS F ' ' 144A ' FRN 15/11/2034	5,497,798	0.05
USD	646,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 ' Series 2017-H1 C ' FRN 15/6/2050	693,503	0.01
USD	2,640,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 ' Series 2017-H1 XD ' ' 144A ' FRN 15/6/2050	369,151	0.00
USD	970,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 ' Series 2018-H3 C ' FRN 15/7/2051	1,097,934	0.01
USD	880,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 ' Series 2018-H3 D ' ' 144A ' 3% 15/7/2051	834,005	0.01
USD	109,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 ' Series 2018-H3 A5 ' 4.177% 15/7/2051	126,179	0.00
USD	4,004,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP ' Series 2018-MP E ' ' 144A ' FRN 11/7/2040	4,202,454	0.04
USD	911,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN ' Series 2018-SUN F ' ' 144A ' FRN 15/7/2035	916,298	0.01
USD	920,022	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-9SL ' Series 2007-9SL A ' FRN 25/7/2037	886,123	0.01
USD	7,131,827	Mortgage Loan Resecuritization Trust ' Series 2009-RS1 A85 ' ' 144A ' FRN 16/4/2036	6,477,701	0.06
USD	3,103,177	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1 ' Series 2018-1A A ' ' 144A ' 4.01% 22/6/2043	3,284,891	0.03
USD	3,879,517	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS ' Series 2018-2GS A ' ' 144A ' 4.2% 22/2/2044	4,167,704	0.04
USD	1,470,000	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS ' Series 2018-2GS C ' ' 144A ' 5.97% 22/2/2044	1,526,098	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 9,927,988	Mosaic Solar Loan Trust 2019-1 ' Series 2019-1A A ' ' 144A ' 4.37% 21/12/2043	10,624,384	0.10
USD 4,781,921	Mosaic Solar Loan Trust 2019-2 ' Series 2019-2A A ' ' 144A ' 2.88% 20/9/2040	4,901,854	0.05
USD 3,014,583	Mountain Hawk II CLO Ltd ' Series 2013-2A BR ' ' 144A ' FRN 20/7/2024	3,015,261	0.03
USD 1,624,189	Mountain Hawk III CLO Ltd ' Series 2014-3A AR ' ' 144A ' FRN 18/4/2025	1,626,109	0.02
USD 1,895,000	MP CLO VII Ltd ' Series 2015-1A ARR ' ' 144A ' FRN 18/10/2028	1,898,426	0.02
USD 500,000	MP CLO VII Ltd ' Series 2015-1A BRR ' ' 144A ' FRN 18/10/2028	493,892	0.00
USD 3,538,000	MPLX LP ' 144A ' 6.25% 15/10/2022	3,596,811	0.03
GBP 250,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 2.55% 5/12/2023	328,916	0.00
EUR 750,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.325% 24/3/2025	913,846	0.01
GBP 150,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.692% 5/6/2028	204,906	0.00
USD 306,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 4.625% 1/8/2029	322,669	0.00
USD 1,597,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5% 15/10/2027	1,692,860	0.02
USD 444,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.25% 1/8/2026	469,451	0.00
USD 649,102	Multi Security Asset Trust LP Commercial Mortgage-Backed Securities Pass-Through ' Series 2005-RR4A N ' ' 144A ' FRN 28/11/2035	654,892	0.01
USD 1,684,000	National Retail Properties Inc 2.5% 15/4/2030	1,698,089	0.02
USD 90,621	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-C ' Series 2007-C 2AV3 ' FRN 25/6/2037	90,705	0.00
USD 665,000	Nationstar Mortgage Holdings Inc ' 144A ' 6% 15/1/2027	681,276	0.01
USD 2,472,000	Nationstar Mortgage Holdings Inc ' 144A ' 9.125% 15/7/2026	2,709,188	0.03
USD 691,598	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2018-FL1 ' Series 2018-FL1 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2035	691,443	0.01
USD 1,195,978	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2018-FL1 ' Series 2018-FL1 MCR1 ' ' 144A ' FRN 15/6/2035	1,193,211	0.01
USD 205,000	Navient Corp 6.75% 25/6/2025	222,130	0.00
USD 205,000	Navient Corp 6.75% 15/6/2026	219,627	0.00
USD 210,000	Navient Corp 7.25% 25/9/2023	230,368	0.00
USD 3,020,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-A ' Series 2014-AA B ' ' 144A ' 3.5% 15/8/2044	3,149,009	0.03
USD 2,278,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-A ' Series 2015-AA B ' ' 144A ' 3.5% 15/12/2044	2,392,123	0.02
USD 5,000,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-B ' Series 2015-BA A3 ' ' 144A ' FRN 16/7/2040	5,062,295	0.05
USD 6,630,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2018-D ' Series 2018-DA A2A ' ' 144A ' 4% 15/12/2059	7,000,787	0.07
USD 6,300,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2019-D ' Series 2019-D A2B ' ' 144A ' FRN 15/12/2059	6,351,319	0.06
USD 7,500,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2019-D ' Series 2019-D A2A ' ' 144A ' 3.01% 15/12/2059	7,753,173	0.07
USD 1,400,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-A ' Series 2020-A A2B ' ' 144A ' FRN 15/11/2068	1,404,056	0.01
USD 2,760,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-A ' Series 2020-A A2A ' ' 144A ' 2.46% 15/11/2068	2,831,788	0.03
USD 1,425,000	NBCUniversal Enterprise Inc ' 144A ' 5.25% 19/3/2021 (Perpetual)	1,472,987	0.01
USD 2,160,000	NBCUniversal Media LLC 4.45% 15/1/2043	2,637,321	0.03
USD 1,119,000	NCR Corp 5% 15/7/2022	1,127,057	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
EUR 1,853,000	Netflix Inc 3.625% 15/6/2030*	2,139,965	0.02
EUR 2,985,000	Netflix Inc 3.875% 15/11/2029	3,455,719	0.03
USD 753,000	Netflix Inc 4.375% 15/11/2026	793,549	0.01
EUR 1,000,000	Netflix Inc 4.625% 15/5/2029	1,225,947	0.01
USD 544,000	Netflix Inc 4.875% 15/4/2028	576,382	0.01
USD 340,000	Netflix Inc '144A' 4.875% 15/6/2030	359,346	0.00
USD 306,000	Netflix Inc '144A' 5.375% 15/11/2029	336,768	0.00
USD 179,000	Netflix Inc 5.5% 15/2/2022	186,611	0.00
USD 272,000	Netflix Inc 5.875% 15/2/2025	304,391	0.00
USD 646,000	Netflix Inc 5.875% 15/11/2028	730,045	0.01
USD 600,000	Netflix Inc 6.375% 15/5/2029	695,070	0.01
USD 780,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd 'Series 2017-16SA A' '144A' FRN 15/1/2028	780,516	0.01
USD 350,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd 'Series 2017-16SA D' '144A' FRN 15/1/2028	347,707	0.00
USD 439,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd 'Series 2015-20A AR' '144A' FRN 15/1/2028	439,208	0.00
USD 1,100,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd 'Series 2015-20A ER' '144A' FRN 15/1/2028	1,081,508	0.01
USD 500,000	Neuberger Berman CLO XXIII Ltd 'Series 2016-23A BR' '144A' FRN 17/10/2027	501,135	0.00
USD 7,100,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd 'Series 2017-26A A' '144A' FRN 18/10/2030	7,105,261	0.07
USD 7,240,000	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 'Series 2005-B M1' FRN 25/10/2035	7,100,181	0.07
USD 1,150,000	New Hope Cultural Education Facilities Finance Corp 5% 15/8/2047	1,398,693	0.01
USD 1,490,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 4.131% 15/6/2042	1,628,555	0.02
USD 780,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5% 15/6/2029	938,913	0.01
USD 2,340,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15/12/2028	2,782,833	0.03
USD 3,615,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 6.104% 15/12/2028	3,748,032	0.04
USD 1,360,000	New Orleans Aviation Board 5% 1/1/2040	1,562,980	0.02
USD 770,000	New York City Transitional Finance Authority Building Aid Revenue 5% 15/7/2040	927,088	0.01
USD 3,695,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.05% 1/5/2027	4,054,893	0.04
USD 4,310,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.35% 1/11/2030	4,834,074	0.05
USD 4,740,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.55% 1/5/2025	5,232,605	0.05
USD 2,650,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.65% 1/11/2024	2,840,177	0.03
USD 2,650,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.75% 1/11/2025	2,840,349	0.03
USD 3,660,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.9% 1/8/2031	4,203,949	0.04
USD 1,590,000	New York City Water & Sewer System 5.44% 15/6/2043	2,435,109	0.02
USD 455,000	New York City Water & Sewer System 5.75% 15/6/2041	707,584	0.01
USD 780,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2040	945,785	0.01
USD 2,000,000	New York Liberty Development Corp '144A' 5% 15/11/2044	2,252,640	0.02
USD 1,875,000	New York State Dormitory Authority 3.142% 1/7/2043	2,039,409	0.02
USD 2,550,000	New York State Dormitory Authority 3.19% 15/2/2043	2,851,627	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,640,000	New York State Urban Development Corp 2.35% 15/3/2027	3,786,565	0.04
USD 1,620,000	New York State Urban Development Corp 3.12% 15/3/2025	1,745,364	0.02
USD 3,655,000	New York State Urban Development Corp 3.32% 15/3/2029	4,008,822	0.04
USD 1,800,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/8/2020	1,826,847	0.02
USD 620,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/7/2046	713,425	0.01
USD 4,940,000	New York Transportation Development Corp 5.25% 1/1/2050	5,722,817	0.05
USD 348,000	Newell Brands Inc 3.85% 1/4/2023	360,880	0.00
USD 680,000	Newell Brands Inc 4.2% 1/4/2026	710,821	0.01
USD 242,000	Newfield Exploration Co 5.375% 1/1/2026	255,934	0.00
USD 685,000	Newmont Corp 2.8% 1/10/2029	710,991	0.01
USD 1,923,000	Nexstar Broadcasting Inc ' 144A ' 5.625% 15/7/2027	1,998,670	0.02
USD 411,000	NGPL PipeCo LLC ' 144A ' 4.875% 15/8/2027	448,746	0.00
USD 6,570,000	NGPL PipeCo LLC ' 144A ' 7.768% 15/12/2037	8,920,338	0.08
USD 5,435,000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co ' 144A ' 5% 15/4/2022*	5,450,653	0.05
USD 307,265	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2001-R1A ' Series 2001-R1A A ' ' 144A ' FRN 19/2/2030	319,109	0.00
USD 503,748	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2006-AF1 (Step-up coupon) ' Series 2006-AF1 1A4 ' 6.634% 25/5/2036	194,385	0.00
USD 276,131	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2006-S5 ' Series 2006-S5 A1 ' ' 144A ' FRN 25/10/2036	262,128	0.00
USD 2,104,787	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2007-2 ' Series 2007-2 A4 ' FRN 25/6/2037	1,767,625	0.02
USD 1,070,000	North Carolina Turnpike Authority 5% 1/1/2035	1,377,357	0.01
USD 45,370	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	46,928	0.00
USD 2,734,000	NRG Energy Inc 2.75% 1/6/2048	2,945,028	0.03
USD 1,146,000	NRG Energy Inc ' 144A ' 5.25% 15/6/2029	1,205,558	0.01
USD 1,223,000	NRG Energy Inc 5.75% 15/1/2028	1,294,974	0.01
USD 1,828,000	NRG Energy Inc 6.625% 15/1/2027	1,926,803	0.02
USD 4,268,000	NRG Energy Inc 7.25% 15/5/2026	4,558,779	0.04
USD 3,030,000	NuStar Logistics LP 4.8% 1/9/2020	3,057,687	0.03
USD 250,000	Oaktree CLO 2014-1 ' Series 2014-1A A2R ' ' 144A ' FRN 13/5/2029	250,457	0.00
USD 3,360,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A A1R ' ' 144A ' FRN 20/10/2027	3,361,342	0.03
USD 2,000,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A DR ' ' 144A ' FRN 20/10/2027	1,918,645	0.02
USD 662,787	Oakwood Mortgage Investors Inc (Defaulted) ' Series 2001-D A2 ' FRN 15/1/2019	481,720	0.00
USD 547,791	Oakwood Mortgage Investors Inc ' Series 2001-D A4 ' FRN 15/9/2031	450,434	0.00
USD 948,000	Ochsner Clinic Foundation 5.897% 15/5/2045	1,374,624	0.01
USD 460,000	OCP CLO 2014-5 Ltd ' Series 2014-5A A1R ' ' 144A ' FRN 26/4/2031	460,115	0.00
USD 1,350,000	OCP CLO 2014-7 Ltd ' Series 2014-7A A2RR ' ' 144A ' FRN 20/7/2029	1,350,008	0.01
USD 1,750,000	OCP CLO 2015-10 Ltd ' Series 2015-10A BR ' ' 144A ' FRN 26/10/2027	1,757,684	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,340,000	OCP CLO 2015-8 Ltd 'Series 2015-8A BR' '144A' FRN 17/4/2027	1,344,734	0.01
USD 2,330,000	OCP CLO 2015-9 Ltd 'Series 2015-9A BR' '144A' FRN 15/7/2027	2,328,335	0.02
USD 440,000	OCP CLO 2016-12 Ltd FRN 18/10/2028	424,683	0.00
USD 4,057,000	OCP CLO 2016-12 Ltd 'Series 2016-12A A1R' '144A' FRN 18/10/2028	4,065,626	0.04
USD 920,000	OCP CLO 2017-13 Ltd 'Series 2017-13A D' '144A' FRN 15/7/2030	903,434	0.01
USD 360,000	OCP CLO 2017-14 Ltd 'Series 2017-14A B' '144A' FRN 20/11/2030	355,467	0.00
USD 5,200,000	Octagon Investment Partners 18-R Ltd 'Series 2018-18A A1A' '144A' FRN 16/4/2031	5,195,647	0.05
USD 250,000	Octagon Investment Partners 30 Ltd 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 17/3/2030	243,005	0.00
USD 1,000,000	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 31 LLC 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 20/7/2030	998,318	0.01
USD 1,625,000	Octagon Investment Partners 33 Ltd 'Series 2017-1A A1' '144A' FRN 20/1/2031	1,630,166	0.02
USD 1,120,000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd FRN 15/7/2027	1,120,273	0.01
USD 1,230,000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd 'Series 2015-1A CR' '144A' FRN 15/7/2027	1,207,922	0.01
USD 2,985,357	OFSI Fund VI Ltd '144A' FRN 20/3/2025	2,985,145	0.03
USD 670,000	OFSI Fund VI Ltd 'Series 2014-6A CR' '144A' FRN 20/3/2025	671,526	0.01
USD 701,766	OFSI Fund VII Ltd 'Series 2014-7A AR' '144A' FRN 18/10/2026	702,085	0.01
USD 730,000	OHA Credit Partners VII Ltd 'Series 2012-7A DR' '144A' FRN 20/11/2027	733,722	0.01
USD 260,000	OHA Credit Partners XIII Ltd 'Series 2016-13A E' '144A' FRN 21/1/2030	261,100	0.00
USD 1,633,000	OHA Loan Funding 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A AR' '144A' FRN 23/5/2031	1,631,721	0.02
USD 1,000,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.25% 15/8/2043	1,233,830	0.01
USD 4,480,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.5% 15/8/2057	5,539,094	0.05
USD 2,340,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 'Series 2017-OT E' '144A' FRN 10/5/2039	2,458,071	0.02
USD 29,500,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 'Series 2017-OT XA' '144A' FRN 10/5/2039	803,285	0.01
USD 43,880,000	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 'Series 2017-1MKT XCP' '144A' FRN 10/2/2032	127,691	0.00
USD 6,900,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 'Series 2018-1A B' '144A' 3.61% 14/3/2029	7,106,144	0.07
USD 14,310,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 'Series 2019-2A A' '144A' 3.14% 14/10/2036	14,882,839	0.14
USD 1,283,514	Option One Mortgage Loan Trust 2006-3 'Series 2006-3 1A1' FRN 25/2/2037	1,001,237	0.01
USD 1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust 2007-CP1 'Series 2007-CP1 2A3' FRN 25/3/2037	1,390,478	0.01
USD 6,505,718	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD1 1A1' 5.866% 25/1/2037	6,679,263	0.06
USD 7,155,543	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD1 2A1' 5.866% 25/1/2037	7,338,331	0.07
USD 9,441,448	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD2 1A1' 5.82% 25/3/2037	9,800,248	0.09
USD 3,255,000	Orange County Local Transportation Authority 6.908% 15/2/2041	4,995,058	0.05
USD 4,395,000	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	5,044,757	0.05
USD 5,005,000	Oregon School Boards Association 5.55% 30/6/2028	6,153,322	0.06
USD 3,575,000	Oregon School Boards Association 5.68% 30/6/2028	4,451,930	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 669,751	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2001-A ' Series 2001-A M1 ' FRN 15/3/2032	684,475	0.01
USD 1,605,203	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2007-B ' Series 2007-B A1 ' ' 144A ' FRN 15/10/2037	1,542,366	0.01
USD 6,505,000	Otis Worldwide Corp ' 144A ' 2.565% 15/2/2030	6,629,652	0.06
USD 780,000	Otis Worldwide Corp ' 144A ' 3.362% 15/2/2050	802,898	0.01
USD 170,000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp ' 144A ' 4.625% 15/3/2030	174,139	0.00
USD 743,000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp ' 144A ' 5% 15/8/2027	774,095	0.01
USD 291,000	Owens-Brockway Glass Container Inc ' 144A ' 5.875% 15/8/2023	310,571	0.00
USD 1,590,000	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 (Step-up coupon) ' Series 2006-2 A2C ' 6% 25/1/2037	1,564,188	0.02
USD 2,850,000	OZLM Funding IV Ltd ' Series 2013-4A A1R ' ' 144A ' FRN 22/10/2030	2,843,009	0.03
USD 290,000	OZLM Funding IV Ltd ' Series 2013-4A A2R ' ' 144A ' FRN 22/10/2030	288,564	0.00
USD 250,000	OZLM Funding Ltd ' Series 2012-1A A2R2 ' ' 144A ' FRN 22/7/2029	250,055	0.00
USD 300,000	OZLM VI Ltd ' Series 2014-6A A2AS ' ' 144A ' FRN 17/4/2031	300,659	0.00
USD 3,200,000	OZLM VI Ltd ' Series 2014-6A SUB ' ' 144A ' FRN 17/4/2031	913,725	0.01
USD 500,000	OZLM VII Ltd ' Series 2014-7RA A2R ' ' 144A ' FRN 17/7/2029	500,437	0.00
USD 1,185,000	OZLM VIII Ltd ' Series 2014-8A A2RR ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	1,182,064	0.01
USD 1,250,000	OZLM VIII Ltd ' Series 2014-8A BRR ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	1,218,246	0.01
USD 1,065,000	OZLM VIII Ltd ' Series 2014-8A CRR ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	1,031,940	0.01
USD 250,000	OZLM XII Ltd ' Series 2015-12A A2R ' ' 144A ' FRN 30/4/2027	249,134	0.00
USD 1,630,000	OZLM XIV Ltd ' Series 2015-14A B1R ' ' 144A ' FRN 15/1/2029	1,615,632	0.02
USD 2,190,000	OZLM XIV Ltd ' Series 2015-14A CR ' ' 144A ' FRN 15/1/2029	2,088,938	0.02
USD 2,250,000	OZLM XIX Ltd ' Series 2017-19A A1 ' ' 144A ' FRN 22/11/2030	2,261,910	0.02
USD 2,120,000	OZLM XV Ltd ' Series 2016-15A A1 ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	2,120,280	0.02
USD 830,000	OZLM XV Ltd ' Series 2016-15A A2A ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	831,699	0.01
USD 440,000	OZLM XV Ltd ' Series 2016-15A C ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	438,183	0.00
USD 893,000	OZLM XVIII Ltd ' Series 2018-18A A ' ' 144A ' FRN 15/4/2031	887,066	0.01
USD 250,000	OZLM XX Ltd ' Series 2018-20A A2 ' ' 144A ' FRN 20/4/2031	248,429	0.00
USD 580,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd ' Series 2014-1A A1R2 ' ' 144A ' FRN 17/1/2031	579,314	0.01
USD 2,090,000	Palmer Square CLO 2018-1 Ltd ' Series 2018-1A A1 ' ' 144A ' FRN 18/4/2031	2,077,661	0.02
USD 500,000	Palmer Square CLO 2018-2 Ltd ' Series 2018-2A A2 ' ' 144A ' FRN 16/7/2031	500,709	0.00
USD 3,502,000	Palmer Square CLO 2018-3 Ltd ' Series 2018-3A A2 ' ' 144A ' FRN 15/8/2026	3,492,530	0.03
USD 719,151	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd ' Series 2018-4A A1 ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	719,973	0.01
USD 1,780,000	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd ' Series 2018-4A B ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	1,766,928	0.02
USD 1,550,000	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd ' Series 2018-4A C ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	1,483,679	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,512,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd FRN 20/1/2027	3,491,942	0.03
USD 2,245,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd FRN 20/1/2027	2,231,494	0.02
USD 350,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd ' Series 2018-5A D ' ' 144A ' FRN 20/1/2027	347,107	0.00
EUR 1,635,000	Panther BF Aggregator 2 LP / Panther Finance Co Inc 4.375% 15/5/2026	1,764,902	0.02
USD 418,000	Panther BF Aggregator 2 LP / Panther Finance Co Inc ' 144A ' 6.25% 15/5/2026	436,152	0.00
USD 92,778	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	88,749	0.00
USD 1,350,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2016-1 ' Series 2016-1A DR ' ' 144A ' FRN 23/8/2031	1,321,367	0.01
USD 2,525,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 ' Series 2017-1A A1 ' ' 144A ' FRN 14/11/2029	2,526,881	0.02
USD 2,320,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 ' Series 2017-1A A2 ' ' 144A ' FRN 14/11/2029	2,320,306	0.02
USD 3,100,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 ' Series 2017-1A B ' ' 144A ' FRN 14/11/2029	3,050,794	0.03
USD 2,830,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 ' Series 2017-1A D ' ' 144A ' FRN 14/11/2029	2,729,304	0.03
USD 6,006,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp ' 144A ' 5.25% 15/8/2025	5,997,682	0.06
USD 10,638,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp ' 144A ' 5.375% 15/1/2025	10,717,679	0.10
USD 3,223,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp ' 144A ' 5.625% 15/10/2027	3,220,905	0.03
USD 4,860,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp ' 144A ' 6.25% 1/6/2024	5,103,559	0.05
USD 8,745,000	PayPal Holdings Inc 2.65% 1/10/2026	9,088,155	0.09
USD 204,000	PDC Energy Inc 5.75% 15/5/2026	185,900	0.00
USD 1,000,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2022	1,106,230	0.01
USD 400,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2038	475,390	0.00
USD 915,000	Pennsylvania Turnpike Commission 5% 1/12/2046	1,102,410	0.01
USD 2,470,000	Pennsylvania Turnpike Commission 5% 1/12/2048	3,060,663	0.03
USD 972,000	Pilgrim ' s Pride Corp ' 144A ' 5.875% 30/9/2027	1,006,564	0.01
USD 2,365,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 1/10/2062	3,245,679	0.03
USD 260,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.926% 1/10/2051	340,268	0.00
USD 830,000	Port of Seattle WA 5% 1/5/2043	1,000,669	0.01
USD 703,000	Post Holdings Inc ' 144A ' 5% 15/8/2026	721,883	0.01
USD 314,000	Post Holdings Inc ' 144A ' 5.5% 15/12/2029	325,979	0.00
USD 661,000	Presidio Holdings Inc ' 144A ' 8.25% 1/2/2028	691,373	0.01
USD 1,290,000	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV Ltd ' Series 2015-4A C ' ' 144A ' 4% 24/8/2049	1,340,310	0.01
USD 9,500,000	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI Ltd ' Series 2016-6A C ' ' 144A ' 4% 24/8/2040	9,540,850	0.09
USD 281,420	Prime Mortgage Trust 2006-DR1 ' Series 2006-DR1 2A1 ' ' 144A ' 5.5% 25/5/2035	272,097	0.00
USD 590,000	Progress Residential 2015-SFR3 Trust ' Series 2015-SFR3 F ' ' 144A ' 6.643% 12/11/2032	590,310	0.01
USD 2,082,375	Progress Residential 2017-SFR1 Trust ' Series 2017-SFR1 A ' ' 144A ' 2.768% 17/8/2034	2,115,738	0.02
USD 1,480,000	Progress Residential 2018-SFR1 Trust ' Series 2018-SFR1 F ' ' 144A ' 4.778% 17/3/2035	1,513,584	0.01
USD 920,000	Progress Residential 2018-SFR2 Trust ' Series 2018-SFR2 F ' ' 144A ' 4.953% 17/8/2035	951,571	0.01
EUR 1,655,000	Prologis Euro Finance LLC 0.25% 10/9/2027	1,807,020	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 134,000	PulteGroup Inc 4.25% 1/3/2021	135,394	0.00
USD 396,000	PulteGroup Inc 5% 15/1/2027	438,797	0.00
USD 5,788,000	PulteGroup Inc 5.5% 1/3/2026	6,487,031	0.06
USD 43,000	PulteGroup Inc 6% 15/2/2035	50,637	0.00
USD 3,255,000	PulteGroup Inc 7.875% 15/6/2032	4,404,736	0.04
USD 1,123,000	Qorvo Inc ' 144A ' 4.375% 15/10/2029	1,160,256	0.01
USD 3,075,000	Qorvo Inc 5.5% 15/7/2026	3,205,362	0.03
USD 1,494,000	Quicken Loans Inc ' 144A ' 5.25% 15/1/2028	1,561,533	0.02
USD 12,133,000	Quicken Loans Inc ' 144A ' 5.75% 1/5/2025	12,457,982	0.12
USD 630,000	Race Point IX CLO Ltd ' Series 2015-9A A1AR ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	629,991	0.01
USD 1,004,442	RALI Series 2007-QH9 Trust ' Series 2007-QH9 A1 ' FRN 25/11/2037	952,994	0.01
USD 1,274,459	RAMP Series 2004-RS7 Trust ' Series 2004-RS7 A2A ' FRN 25/7/2034	1,079,244	0.01
USD 2,834,133	RASC Series 2006-EMX9 Trust ' Series 2006-EMX9 1A4 ' FRN 25/11/2036	2,324,606	0.02
USD 315,000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp ' 144A ' 9.375% 1/4/2027	328,395	0.00
EUR 2,623,000	Refinitiv US Holdings Inc 4.5% 15/5/2026	3,099,162	0.03
USD 7,490,000	Refinitiv US Holdings Inc ' 144A ' 6.25% 15/5/2026	8,093,844	0.08
USD 1,250,000	Regatta IX Funding Ltd ' Series 2017-1A B ' ' 144A ' FRN 17/4/2030	1,241,905	0.01
USD 250,000	Regatta VII Funding Ltd ' Series 2016-1A BR ' ' 144A ' FRN 20/12/2028	245,739	0.00
USD 2,605,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 6.583% 15/5/2049	4,101,273	0.04
USD 131,620	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R3 ' Series 2005-R3 AF ' ' 144A ' FRN 25/9/2035	122,867	0.00
USD 2,453,000	Republic Services Inc 2.3% 1/3/2030	2,452,816	0.02
USD 1,370,407	Residential Asset Securitization Trust 2005-A5 ' Series 2005-A5 A5 ' FRN 25/5/2035	1,118,246	0.01
USD 141,000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu ' 144A ' 7% 15/7/2024	143,690	0.00
USD 2,450,000	Rockford Tower CLO 2017-1 Ltd ' Series 2017-1A E ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	2,267,557	0.02
USD 1,881,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd ' Series 2017-2A B ' ' 144A ' FRN 15/10/2029	1,882,161	0.02
USD 1,250,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd ' Series 2017-2A C ' ' 144A ' FRN 15/10/2029	1,241,746	0.01
USD 4,390,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd ' Series 2017-2A D ' ' 144A ' FRN 15/10/2029	4,397,807	0.04
USD 3,490,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd ' Series 2017-2A E ' ' 144A ' FRN 15/10/2029	3,459,929	0.03
USD 11,396,992	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd ' Series 2017-3A A ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	11,417,500	0.11
USD 350,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd ' Series 2017-3A B ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	345,494	0.00
USD 3,015,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd ' Series 2017-3A E ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	2,870,622	0.03
USD 1,000,000	Rockford Tower CLO 2018-1 Ltd ' Series 2018-1A A ' ' 144A ' FRN 20/5/2031	1,001,776	0.01
USD 1,250,000	Rockford Tower CLO 2018-1 Ltd ' Series 2018-1A B ' ' 144A ' FRN 20/5/2031	1,250,272	0.01
USD 250,000	Rockford Tower CLO 2018-1 Ltd ' Series 2018-1A D ' ' 144A ' FRN 20/5/2031	250,476	0.00
USD 341,000	Rockford Tower CLO 2018-2 Ltd ' Series 2018-2A A ' ' 144A ' FRN 20/10/2031	340,510	0.00
USD 813,000	Rockford Tower CLO 2018-2 Ltd ' Series 2018-2A B ' ' 144A ' FRN 20/10/2031	816,174	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 560,000	Rockford Tower CLO 2018-2 Ltd 'Series 2018-2A E' '144A' FRN 20/10/2031	539,613	0.01
USD 13,621,000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 5.625% 15/4/2020	13,662,334	0.13
USD 425,000	Romark WM-R Ltd 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 20/4/2031	422,429	0.00
USD 2,201,000	Rosslyn Portfolio Trust 2017-ROSS 'Series 2017-ROSS E' '144A' FRN 15/6/2033	2,215,091	0.02
USD 960,000	Royal Oak Hospital Finance Authority 5% 1/9/2039	1,091,822	0.01
USD 550,000	RR 2 Ltd 'Series 2017-2A A2' '144A' FRN 15/10/2029	550,526	0.01
USD 1,657,000	RR 2 Ltd 'Series 2017-2A B' '144A' FRN 15/10/2029	1,634,246	0.02
USD 410,000	RR 2 Ltd 'Series 2017-2A D' '144A' FRN 15/10/2029	406,666	0.00
USD 250,000	RR 3 Ltd 'Series 2018-3A A1R2' '144A' FRN 15/1/2030	250,187	0.00
USD 2,000,000	RR 4 Ltd 'Series 2018-4A A2' '144A' FRN 15/4/2030	1,966,207	0.02
USD 1,405,000	Rutgers The State University of New Jersey 3.27% 1/5/2043	1,526,828	0.01
USD 875,000	RWJ Barnabas Health Inc 3.477% 1/7/2049	967,715	0.01
USD 238,000	Ryman Hospitality Properties Inc '144A' 4.75% 15/10/2027	244,105	0.00
USD 2,245,000	Sabre GBLB Inc '144A' 5.25% 15/11/2023	2,266,350	0.02
USD 2,500,000	Sabre GBLB Inc '144A' 5.375% 15/4/2023	2,530,213	0.02
USD 311,198	SACO I Trust 2006-9 'Series 2006-9 A1' FRN 25/8/2036	307,480	0.00
USD 6,420,000	Sacramento County Sanitation Districts Financing Authority FRN 1/12/2035	6,321,357	0.06
USD 5,310,000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 5% 1/12/2045	6,356,309	0.06
USD 2,050,000	San Antonio Water System 5% 15/5/2039	2,428,912	0.02
USD 1,000,000	San Diego Public Facilities Financing Authority 5% 15/5/2039	1,233,695	0.01
USD 3,425,000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 2.958% 1/8/2024	3,654,629	0.03
USD 1,325,000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.176% 1/8/2026	1,452,770	0.01
USD 1,015,607	Saxon Asset Securities Trust 2007-1 'Series 2007-1 M1' FRN 25/1/2047	838,386	0.01
USD 931,000	Scientific Games International Inc '144A' 5% 15/10/2025	937,983	0.01
USD 2,845,000	Scientific Games International Inc '144A' 7% 15/5/2028	2,821,330	0.03
USD 3,782,260	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 'Series 2017-3 B' '144A' 25/7/2056 (Zero Coupon)	429,090	0.00
USD 5,174,303	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 'Series 2017-3 B10' '144A' FRN 25/7/2056	672,646	0.01
USD 509,206	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 'Series 2018-1 BX' FRN 25/5/2057	251,339	0.00
USD 470,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 'Series 2018-1 M' FRN 25/5/2057	505,348	0.01
USD 2,390,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 'Series 2018-3 M' '144A' FRN 25/8/2057	2,568,792	0.02
USD 5,074,596	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006-WM4 'Series 2006-WM4 A1' '144A' FRN 25/11/2036	3,122,813	0.03
USD 1,266,210	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006-WM4 'Series 2006-WM4 A2A' FRN 25/11/2036	497,051	0.00
USD 3,791,904	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006-WM4 'Series 2006-WM4 A2C' FRN 25/11/2036	1,518,736	0.01
USD 434,805	Security National Mortgage Loan Trust 2007-1 'Series 2007-1A 2A' '144A' FRN 25/4/2037	432,291	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 506,000	Select Medical Corp ' 144A ' 6.25% 15/8/2026	546,751	0.01
USD 64,850	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 ' Series 2014-1A AR ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	64,891	0.00
USD 1,750,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 ' Series 2014-1A CR ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	1,760,186	0.02
USD 1,590,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 ' Series 2014-1A D ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	1,593,892	0.02
USD 250,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 ' Series 2014-1A SUB ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	27,785	0.00
USD 1,554,000	Sequoia Mortgage Trust 2007-3 ' Series 2007-3 2AA1 ' FRN 20/7/2037	1,490,743	0.01
USD 1,100,000	SES GLOBAL Americas Holdings GP ' 144A ' 5.3% 25/3/2044	1,239,526	0.01
USD 5,621,750	Sesac Finance LLC ' Series 2019-1 A2 ' ' 144A ' 5.216% 25/7/2049	5,987,596	0.06
USD 1,369,006	SG Mortgage Securities Trust 2006-FRE2 ' Series 2006-FRE2 A2C ' FRN 25/7/2036	436,114	0.00
USD 1,310,000	SG Mortgage Securities Trust 2006-OPT2 ' Series 2006-OPT2 A3D ' FRN 25/10/2036	1,099,623	0.01
USD 3,120,000	Shackleton 2013-III CLO Ltd ' Series 2013-3A AR ' ' 144A ' FRN 15/7/2030	3,117,707	0.03
USD 1,000,000	Shackleton 2019-XV CLO Ltd ' Series 2019-15A B ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	1,000,591	0.01
USD 44,000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp ' 144A ' 5.875% 1/4/2023	44,568	0.00
EUR 1,493,000	Silgan Holdings Inc 2.25% 1/6/2028	1,637,492	0.02
USD 1,000,000	Silgan Holdings Inc ' 144A ' 4.125% 1/2/2028	1,008,300	0.01
USD 3,750,000	Silver Creek CLO Ltd ' Series 2014-1A AR ' ' 144A ' FRN 20/7/2030	3,771,329	0.04
USD 1,000,000	Silver Creek CLO Ltd ' Series 2014-1A DR ' ' 144A ' FRN 20/7/2030	996,605	0.01
USD 500,000	Silver Creek CLO Ltd ' Series 2014-1A E1R ' ' 144A ' FRN 20/7/2030	460,844	0.00
USD 1,739,000	Sirius XM Radio Inc ' 144A ' 3.875% 1/8/2022	1,752,204	0.02
USD 5,301,000	Sirius XM Radio Inc ' 144A ' 4.625% 15/7/2024	5,495,361	0.05
USD 2,854,000	Sirius XM Radio Inc ' 144A ' 5% 1/8/2027	3,001,495	0.03
USD 248,000	Sirius XM Radio Inc ' 144A ' 5.375% 15/4/2025	254,866	0.00
USD 600,000	Sirius XM Radio Inc ' 144A ' 5.375% 15/7/2026	626,235	0.01
USD 3,820,000	Sirius XM Radio Inc ' 144A ' 5.5% 1/7/2029	4,137,633	0.04
USD 1,547,000	Six Flags Entertainment Corp ' 144A ' 4.875% 31/7/2024	1,524,437	0.01
USD 444,000	Six Flags Entertainment Corp ' 144A ' 5.5% 15/4/2027	428,038	0.00
USD 3,220,000	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-B ' Series 2004-B A4 ' FRN 15/9/2033	3,120,077	0.03
USD 1,074,414	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-B ' Series 2004-B B ' FRN 15/9/2033	1,071,953	0.01
USD 11,970,000	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A ' Series 2005-A A4 ' FRN 15/12/2038	11,700,151	0.11
USD 10,328,621	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B ' Series 2005-B A4 ' FRN 15/6/2039	10,167,747	0.10
USD 4,033,498	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B ' Series 2005-B B ' FRN 15/6/2039	4,009,351	0.04
USD 11,109,560	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A ' Series 2006-A A5 ' FRN 15/6/2039	10,883,814	0.10
USD 12,226,272	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B ' Series 2006-B A5 ' FRN 15/12/2039	11,925,321	0.11
USD 4,215,310	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B ' Series 2006-BW A5 ' FRN 15/12/2039	4,115,247	0.04
USD 6,525,115	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A ' Series 2007-A A4A ' FRN 16/12/2041	6,399,499	0.06

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 8,220,000	SLM Private Education Loan Trust 2010-C ' Series 2010-C A5 ' ' 144A ' FRN 15/10/2041	9,158,956	0.09
USD 5,443	SLM Private Education Loan Trust 2011-C 4.54% 17/10/2044	5,452	0.00
USD 4,740,000	SLM Private Education Loan Trust 2014-A ' Series 2014-A B ' ' 144A ' 3.5% 15/11/2044	4,828,000	0.05
USD 582,000	SM Energy Co 1.5% 1/7/2021	561,126	0.01
USD 170,000	SM Energy Co 5.625% 1/6/2025	136,020	0.00
USD 170,000	SM Energy Co 6.625% 15/1/2027	131,295	0.00
USD 170,000	SM Energy Co 6.75% 15/9/2026	138,916	0.00
USD 7,010,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-B ' Series 2015-B B ' ' 144A ' 3.5% 17/12/2040	7,301,357	0.07
USD 1,910,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C ' Series 2015-C B ' ' 144A ' 3.5% 15/9/2043	2,005,376	0.02
USD 7,820,000	SMB Private Education Loan Trust 2019-B ' Series 2019-B A2A ' ' 144A ' 2.84% 15/6/2037	8,095,403	0.08
USD 1,800,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A ' Series 2020-A B ' ' 144A ' 3% 15/8/2045	1,848,963	0.02
USD 10,000,000	Sofi Professional Loan Program 2018-C Trust ' Series 2018- C A2FX ' ' 144A ' 3.59% 25/1/2048	10,575,400	0.10
USD 10,000,000	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust ' Series 2018- D A2FX ' ' 144A ' 3.6% 25/2/2048	10,490,432	0.10
USD 1,390,000	Sound Point CLO XI Ltd ' Series 2016-1A CR ' ' 144A ' FRN 20/7/2028	1,372,746	0.01
USD 440,000	Sound Point Clo XIV Ltd ' Series 2016-3A C ' ' 144A ' FRN 23/1/2029	437,483	0.00
USD 3,600,000	Sound Point Clo XV Ltd ' Series 2017-1A C ' ' 144A ' FRN 23/1/2029	3,593,983	0.03
USD 40,228	Soundview Home Loan Trust 2004-WMC1 ' Series 2004-WMC1 M2 ' FRN 25/1/2035	39,574	0.00
USD 2,975,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	3,042,934	0.03
USD 1,700,000	South Carolina Public Service Authority 3.722% 1/12/2023	1,807,330	0.02
USD 3,567,000	South Carolina Public Service Authority 6.454% 1/1/2050	5,910,894	0.06
USD 570,000	Spartanburg County School District No 7 5% 1/3/2048	726,647	0.01
USD 480,000	Springleaf Funding Trust 2016-A ' Series 2016-AA B ' ' 144A ' 3.8% 15/11/2029	481,808	0.00
USD 2,889,000	Sprint Communications Inc ' 144A ' 7% 1/3/2020	2,889,000	0.03
USD 2,967,000	Sprint Corp 7.125% 15/6/2024	3,403,401	0.03
USD 2,070,000	Sprint Corp 7.25% 15/9/2021	2,217,632	0.02
USD 1,100,000	Sprint Corp 7.625% 15/2/2025	1,283,700	0.01
USD 3,448,000	Sprint Corp 7.875% 15/9/2023	3,970,665	0.04
USD 1,011,500	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC ' 144A ' 3.36% 20/9/2021	1,020,958	0.01
USD 4,631,000	SSM Health Care Corp 3.688% 1/6/2023	4,915,856	0.05
USD 1,296,615	STACR Trust 2018-DNA2 ' Series 2018-DNA2 M2 ' ' 144A ' FRN 25/12/2030	1,316,260	0.01
EUR 327,000	Standard Industries Inc/NJ 2.25% 21/11/2026	362,831	0.00
EUR 350,000	Standard Industries Inc/NJ 2.25% 21/11/2026	390,898	0.00
USD 1,478,000	Standard Industries Inc/NJ ' 144A ' 4.75% 15/1/2028	1,514,835	0.01
USD 743,000	Standard Industries Inc/NJ ' 144A ' 5% 15/2/2027	765,158	0.01
USD 380,000	Standard Industries Inc/NJ ' 144A ' 5.375% 15/11/2024	387,805	0.00
USD 77,000	Standard Industries Inc/NJ ' 144A ' 5.5% 15/2/2023	77,865	0.00
USD 11,194,000	Standard Industries Inc/NJ ' 144A ' 6% 15/10/2025	11,642,767	0.11

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 93,985	Staniford Street CLO Ltd ' Series 2014-1A AR ' ' 144A ' FRN 15/6/2025	93,986	0.00
USD 4,915,000	Staples Inc ' 144A ' 7.5% 15/4/2026	4,888,331	0.05
USD 2,450,000	Staples Inc ' 144A ' 10.75% 15/4/2027	2,406,316	0.02
USD 7,170,000	State of California 2.65% 1/4/2026	7,625,725	0.07
USD 2,395,000	State of California 7.3% 1/10/2039	3,846,993	0.04
USD 660,000	State of California 7.35% 1/11/2039	1,066,761	0.01
USD 2,575,000	State of California 7.5% 1/4/2034	4,155,175	0.04
USD 1,360,000	State of California 7.55% 1/4/2039	2,354,106	0.02
USD 4,315,000	State of Connecticut 3.31% 15/1/2026	4,673,965	0.04
USD 3,545,000	State of Connecticut 5.85% 15/3/2032	4,911,190	0.05
USD 4,430,000	State of Minnesota 5% 1/8/2036	5,773,220	0.06
USD 3,230,000	State of New York 2.8% 15/2/2032	3,433,748	0.03
USD 1,630,000	State of Ohio 5% 1/5/2037	1,955,853	0.02
USD 5,365,000	State of Oregon 5.892% 1/6/2027	6,628,458	0.06
USD 930,000	State of Washington 5% 1/8/2040	1,166,452	0.01
USD 2,400,000	State of Washington 5% 1/8/2040	2,872,440	0.03
USD 980,000	State of Washington 5% 1/8/2041	1,226,578	0.01
USD 1,505,000	State of Wisconsin 3.154% 1/5/2027	1,637,666	0.02
USD 1,340,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2036	1,606,626	0.02
USD 1,350,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2038	1,617,948	0.02
USD 228,000	Station Casinos LLC ' 144A ' 5% 1/10/2025	232,845	0.00
USD 365,000	Steel Dynamics Inc 2.8% 15/12/2024	375,199	0.00
USD 57,000	Steel Dynamics Inc 4.125% 15/9/2025	58,446	0.00
USD 1,859,000	Steel Dynamics Inc 5% 15/12/2026	1,987,862	0.02
USD 330,000	Steele Creek Clo 2017-1 Ltd ' Series 2017-1A A ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	328,773	0.00
USD 249,000	Stericycle Inc ' 144A ' 5.375% 15/7/2024	263,068	0.00
USD 510,000	Strata CLO I Ltd FRN 15/1/2031	471,506	0.00
USD 2,320,000	Strata CLO I Ltd FRN 15/1/2118	1,687,976	0.02
USD 1,405,220	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust ' Series 2006-3 4A ' FRN 25/4/2036	1,261,987	0.01
USD 1,626,209	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR2 ' Series 2006-AR2 A1 ' FRN 25/2/2036	1,606,895	0.02
USD 495,541	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5 ' Series 2006-AR5 2A1 ' FRN 25/5/2046	418,689	0.00
USD 11,779,251	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust Series 2006-RF3 ' Series 2006-RF3 1A2 ' ' 144A ' 6% 25/10/2036	9,334,667	0.09
EUR 1,660,000	Stryker Corp 0.25% 3/12/2024	1,830,331	0.02
EUR 2,600,000	Stryker Corp 1% 3/12/2031	2,907,277	0.03
USD 138,329	Sudbury Mill CLO Ltd ' Series 2013-1A A1R ' ' 144A ' FRN 17/1/2026	138,282	0.00
USD 221,326	Sudbury Mill CLO Ltd ' Series 2013-1A A2R ' ' 144A ' FRN 17/1/2026	221,251	0.00
USD 157,000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp 6.125% 15/7/2023	157,981	0.00
USD 795,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	958,563	0.01
USD 816,013	Sun Country 4.7% 15/12/2025	816,013	0.01
USD 1,480,000	Sun Country 7% 15/12/2023	1,480,000	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 584,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.875% 15/1/2023	591,554	0.01
USD 1,353,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.5% 15/2/2026	1,376,471	0.01
USD 3,489,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15/3/2028	3,673,385	0.04
USD 891,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6% 15/4/2027	923,809	0.01
USD 7,738,000	Sutter Health 3.695% 15/8/2028	8,608,523	0.08
USD 300,000	Symphony CLO XVIII Ltd ' Series 2016-18A B ' ' 144A ' FRN 23/1/2028	299,823	0.00
USD 250,000	Symphony CLO XVIII Ltd ' Series 2016-18A D ' ' 144A ' FRN 23/1/2028	250,678	0.00
USD 4,023,000	Talen Energy Supply LLC 6.5% 1/6/2025	3,120,500	0.03
USD 12,509,000	Talen Energy Supply LLC ' 144A ' 7.25% 15/5/2027	12,572,170	0.12
USD 2,966,000	Talen Energy Supply LLC ' 144A ' 10.5% 15/1/2026	2,646,629	0.03
USD 4,520,000	Talos Production LLC / Talos Production Finance Inc 11% 3/4/2022	4,668,310	0.04
USD 255,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5% 15/1/2028	254,158	0.00
USD 700,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.125% 1/2/2025	713,993	0.01
USD 571,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.375% 1/2/2027	583,476	0.01
USD 340,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp ' 144A ' 5.5% 1/3/2030	342,873	0.00
USD 4,887,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.875% 15/4/2026	5,031,039	0.05
USD 870,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.5% 15/7/2027	917,850	0.01
USD 146,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.75% 15/3/2024	150,060	0.00
USD 873,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.875% 15/1/2029	946,659	0.01
USD 5,133,000	Taylor Morrison Communities Inc ' 144A ' 5.875% 15/6/2027	5,771,019	0.06
USD 579,000	TCI-Symphony CLO 2017-1 Ltd ' Series 2017-1A E ' ' 144A ' FRN 15/7/2030	563,916	0.01
USD 4,003,000	TEGNA Inc ' 144A ' 4.625% 15/3/2028	3,929,245	0.04
USD 374,000	TEGNA Inc ' 144A ' 5% 15/9/2029	368,858	0.00
USD 569,000	Teleflex Inc 4.625% 15/11/2027	601,348	0.01
USD 888,000	Tempur Sealy International Inc 5.5% 15/6/2026	928,049	0.01
USD 1,104,000	Tenet Healthcare Corp 4.625% 15/7/2024	1,126,538	0.01
USD 5,640,000	Tenet Healthcare Corp ' 144A ' 4.625% 1/9/2024	5,766,900	0.06
USD 8,638,000	Tenet Healthcare Corp ' 144A ' 4.875% 1/1/2026	8,817,498	0.08
USD 1,405,000	Tenet Healthcare Corp 5.125% 1/5/2025	1,429,588	0.01
USD 1,331,000	Tenet Healthcare Corp ' 144A ' 5.125% 1/11/2027	1,379,249	0.01
USD 2,339,000	Tenet Healthcare Corp ' 144A ' 6.25% 1/2/2027	2,463,552	0.02
USD 860,000	Tennessee Housing Development Agency 3.75% 1/7/2038	959,227	0.01
USD 415,000	Tennessee Housing Development Agency 3.85% 1/7/2043	457,002	0.00
USD 325,000	Tennessee Housing Development Agency 3.95% 1/1/2049	359,668	0.00
USD 683,000	Terex Corp ' 144A ' 5.625% 1/2/2025	697,514	0.01
USD 1,780,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,929,502	0.02
USD 615,000	Texas Municipal Gas Acquisition & Supply Corp I 6.25% 15/12/2026	732,161	0.01
USD 570,000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 5% 31/12/2055	661,137	0.01
USD 4,610,000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 5% 30/6/2058	5,632,106	0.05

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,045,075	Thacher Park CLO Ltd ' Series 2014-1A AR ' ' 144A ' FRN 20/10/2026	1,046,120	0.01
USD 1,000,000	Thacher Park CLO Ltd ' Series 2014-1A CR ' ' 144A ' FRN 20/10/2026	1,001,158	0.01
USD 1,410,000	Thacher Park CLO Ltd ' Series 2014-1A D1R ' ' 144A ' FRN 20/10/2026	1,411,376	0.01
EUR 1,300,000	Thermo Fisher Scientific Inc 1.875% 1/10/2049	1,384,167	0.01
EUR 5,475,000	Thermo Fisher Scientific Inc 2% 15/4/2025	6,508,965	0.06
USD 500,000	THL Credit Wind River 2016-1 CLO Ltd ' Series 2016-1A AR ' ' 144A ' FRN 15/7/2028	500,496	0.00
USD 364,649	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-3 ' Series 2007-3 4A1 ' FRN 25/6/2047	352,021	0.00
USD 250,000	TIAA CLO II Ltd ' Series 2017-1A A ' ' 144A ' FRN 20/4/2029	250,396	0.00
USD 263,000	Tiaa Clo III Ltd ' Series 2017-2A A ' ' 144A ' FRN 16/1/2031	262,653	0.00
USD 750,000	Tiaa Clo III Ltd ' Series 2017-2A B ' ' 144A ' FRN 16/1/2031	737,518	0.01
USD 3,000,000	TICP CLO IX Ltd ' Series 2017-9A A ' ' 144A ' FRN 20/1/2031	2,997,009	0.03
USD 500,000	TICP CLO V 2016-1 Ltd ' Series 2016-5A ER ' ' 144A ' FRN 17/7/2031	472,333	0.00
USD 3,220,000	TICP CLO VII Ltd ' Series 2017-7A E ' ' 144A ' FRN 15/7/2029	3,150,836	0.03
USD 500,000	TICP CLO XI Ltd ' Series 2018-11A A ' ' 144A ' FRN 20/10/2031	499,738	0.00
USD 750,000	TICP CLO XII Ltd ' Series 2018-12A A ' ' 144A ' FRN 15/1/2031	750,601	0.01
USD 5,915,000	Tobacco Settlement Finance Authority 7.467% 1/6/2047	6,561,628	0.06
USD 3,710,000	Tobacco Settlement Financing Corp/VA 6.706% 1/6/2046	3,894,257	0.04
USD 4,169,000	ToII Brothers Finance Corp 3.8% 1/11/2029	4,234,766	0.04
USD 4,112,000	ToII Brothers Finance Corp 4.375% 15/4/2023	4,316,757	0.04
USD 1,298,000	ToII Brothers Finance Corp 4.875% 15/11/2025	1,427,936	0.01
USD 2,917,000	ToII Brothers Finance Corp 4.875% 15/3/2027	3,194,254	0.03
USD 1,840,000	Treman Park CLO Ltd FRN 20/10/2028	1,801,994	0.02
USD 250,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd ' Series 2017-1A A1A ' ' 144A ' FRN 25/7/2029	251,718	0.00
USD 2,173,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd ' Series 2017-1A B ' ' 144A ' FRN 25/7/2029	2,163,113	0.02
USD 750,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd ' Series 2017-1A C ' ' 144A ' FRN 25/7/2029	747,187	0.01
USD 351,000	TRESTLES CLO II Ltd ' Series 2018-2A A2 ' ' 144A ' FRN 25/7/2031	350,996	0.00
USD 640,000	TRESTLES CLO II Ltd ' Series 2018-2A D ' ' 144A ' FRN 25/7/2031	626,308	0.01
USD 1,130,000	TRI Pointe Group Inc 4.875% 1/7/2021	1,162,939	0.01
USD 3,349,000	TRI Pointe Group Inc 5.25% 1/6/2027	3,601,339	0.03
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 Ltd ' Series 2006-1A A2 ' ' 144A ' FRN 3/3/2039	726,167	0.01
USD 730,000	Tricon American Homes 2017-SFR2 Trust ' Series 2017-SFR2 F ' ' 144A ' 5.104% 17/1/2036	769,219	0.01
USD 850,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust ' Series 2018-SFR1 E ' ' 144A ' 4.564% 17/5/2037	910,152	0.01
USD 580,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust ' Series 2018-SFR1 F ' ' 144A ' 4.96% 17/5/2037	620,367	0.01
USD 2,000,000	Tri-County Metropolitan Transportation District of Oregon 5% 1/9/2043	2,523,070	0.02
USD 170,596	Trinitas CLO II Ltd ' Series 2014-2A A1R ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	170,747	0.00
USD 1,400,000	TSASC Inc/NY 5% 1/6/2041	1,619,590	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 135,747	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 2/7/2022	146,050	0.00
USD 204,000	Under Armour Inc 3.25% 15/6/2026	191,387	0.00
USD 1,781,126	United Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/8/2021	1,850,737	0.02
USD 1,372,000	United Airlines 2019-2 Class B Pass Through Trust 3.5% 1/5/2028	1,417,758	0.01
USD 2,587,000	United Rentals North America Inc 3.875% 15/11/2027	2,621,019	0.03
USD 1,109,000	United Rentals North America Inc 4.625% 15/10/2025	1,139,037	0.01
USD 3,161,000	United Rentals North America Inc 4.875% 15/1/2028	3,287,756	0.03
USD 255,000	United Rentals North America Inc 5.25% 15/1/2030	268,783	0.00
USD 4,942,000	United Rentals North America Inc 5.5% 15/7/2025	5,111,931	0.05
USD 1,907,000	United Rentals North America Inc 5.5% 15/5/2027	2,018,130	0.02
USD 1,907,000	United Rentals North America Inc 5.875% 15/9/2026	2,032,338	0.02
USD 1,643,000	United Rentals North America Inc 6.5% 15/12/2026	1,764,664	0.02
USD 210,000,000	United States Treasury Bill 3/3/2020 (Zero Coupon)	209,965,409	2.00
USD 210,000,000	United States Treasury Bill 5/3/2020 (Zero Coupon)	209,947,939	2.00
USD 54,495,800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/10/2024	56,076,724	0.53
USD 9,431,100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.25% 15/1/2025	10,554,213	0.10
USD 429,613,500	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/4/2024 †	452,960,835	4.30
USD 45,577,800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/4/2023*	48,515,114	0.46
USD 24,995,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.875% 15/1/2029	28,091,393	0.27
USD 150,300,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 31/8/2021*	151,444,864	1.44
USD 100,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 30/9/2021*	100,828,125	0.96
USD 23,080,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/2/2030	23,515,454	0.22
USD 42,173,000	United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/8/2029*	43,906,047	0.42
USD 45,600,000	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/11/2029*	48,004,688	0.46
USD 10,916,000	United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/8/2049 †	12,346,167	0.12
USD 33,430,000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/5/2029*	36,976,714	0.35
USD 15,470,000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/11/2049 †	17,968,163	0.17
USD 595,000	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2048	771,408	0.01
USD 1,895,000	UnitedHealth Group Inc 3.7% 15/8/2049	2,109,750	0.02
USD 1,562,000	UnitedHealth Group Inc 3.875% 15/8/2059	1,761,288	0.02
USD 3,265,000	UnitedHealth Group Inc 4.25% 15/6/2048	3,932,464	0.04
USD 1,480,000	University of California 3.063% 1/7/2025	1,601,708	0.02
USD 3,975,000	University of California 3.349% 1/7/2029	4,472,590	0.04
USD 1,665,000	University of California 4.601% 15/5/2031	1,995,527	0.02
USD 1,290,000	University of California 5% 15/5/2032	1,562,254	0.02
USD 2,595,000	University of California 5.77% 15/5/2043	3,771,703	0.04
USD 2,500,000	University of Michigan 5% 1/4/2047	3,096,650	0.03
USD 172,000	University of Southern California 3.028% 1/10/2039	188,879	0.00
USD 2,075,000	University of Vermont & State Agricultural College 5% 1/10/2043	2,568,964	0.02
USD 810,000	US 2018-USDC ' Series 2018-USDC E ' ' 144A ' FRN 13/5/2038	884,875	0.01
USD 1,300,000	US 2018-USDC ' Series 2018-USDC F ' ' 144A ' FRN 13/5/2038	1,372,716	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,129,303	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/11/2025	2,288,583	0.02
USD 675,016	US Airways 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/11/2021	706,598	0.01
USD 356,000	US Concrete Inc 6.375% 1/6/2024	365,475	0.00
USD 170,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ' Series 2016-2 M2 ' FRN 25/10/2046	173,669	0.00
USD 710,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ' Series 2016-2 M3 ' FRN 25/10/2046	731,912	0.01
USD 310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ' Series 2016-2 M4 ' FRN 25/10/2046	323,489	0.00
USD 330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 ' Series 2017-1 M2 ' ' 144A ' FRN 25/5/2047	337,478	0.00
USD 330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 ' Series 2017-1 M3 ' ' 144A ' FRN 25/5/2047	343,415	0.00
USD 1,794,581	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 ' Series 2017-2 M3 ' ' 144A ' FRN 25/11/2047	1,852,353	0.02
USD 298,485	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 ' Series 2017-2 M4 ' ' 144A ' FRN 25/11/2047	308,826	0.00
USD 306,975	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2018-1 ' Series 2018-1 M2 ' ' 144A ' 4.26% 25/4/2048	319,738	0.00
EUR 2,240,000	Verizon Communications Inc 3.25% 17/2/2026	2,897,906	0.03
USD 5,315,000	Verizon Communications Inc 4.016% 3/12/2029	6,130,313	0.06
USD 1,360,000	Vertiv Group Corp ' 144A ' 9.25% 15/10/2024	1,454,357	0.01
USD 1,254,000	Vibrant Clo VII Ltd ' Series 2017-7A A1 ' ' 144A ' FRN 15/9/2030	1,254,449	0.01
USD 14,756,000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc ' 144A ' 3.5% 15/2/2025	14,789,275	0.14
USD 2,582,000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc ' 144A ' 3.75% 15/2/2027	2,586,841	0.02
USD 3,086,000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc ' 144A ' 4.125% 15/8/2030	3,099,810	0.03
USD 7,696,000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc ' 144A ' 4.25% 1/12/2026	7,825,408	0.07
USD 4,671,000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc ' 144A ' 4.625% 1/12/2029	4,860,876	0.05
USD 2,270,000	Virginia Small Business Financing Authority 5% 31/12/2052	2,701,300	0.03
USD 1,002,000	Vistra Energy Corp 5.875% 1/6/2023	1,020,657	0.01
USD 16,316,000	Vistra Operations Co LLC ' 144A ' 3.55% 15/7/2024	16,854,569	0.16
USD 7,973,000	Vistra Operations Co LLC ' 144A ' 5% 31/7/2027	8,037,980	0.08
USD 1,903,000	Vistra Operations Co LLC ' 144A ' 5.5% 1/9/2026	1,936,193	0.02
USD 1,934,000	Vistra Operations Co LLC ' 144A ' 5.625% 15/2/2027	1,983,994	0.02
USD 450,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust ' Series 2013-PENN D ' ' 144A ' FRN 13/12/2029	453,009	0.00
USD 885,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust ' Series 2013-PENN E ' ' 144A ' FRN 13/12/2029	887,996	0.01
USD 1,855,000	Voya CLO 2013-2 Ltd ' Series 2013-2A A1R ' ' 144A ' FRN 25/4/2031	1,847,377	0.02
USD 270,000	Voya CLO 2014-3 Ltd ' Series 2014-3A CR ' ' 144A ' FRN 25/7/2026	267,394	0.00
USD 750,000	Voya CLO 2015-2 Ltd ' Series 2015-2A BR ' ' 144A ' FRN 23/7/2027	751,570	0.01
USD 665,000	Voya CLO 2017-3 Ltd ' Series 2017-3A A1A ' ' 144A ' FRN 20/7/2030	666,744	0.01
USD 3,500,000	Voya Clo 2017-4 Ltd ' Series 2017-4A A1 ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	3,497,300	0.03
EUR 422,000	Voya Euro CLO I DAC FRN 15/10/2030	413,368	0.00
USD 16,099,855	Voyager OPTONE Delaware Trust ' Series 2009-1 SAA7 ' ' 144A ' FRN 25/2/2038	5,891,999	0.06

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,854,378	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007-HE2 Trust ' Series 2007-HE2A A ' ' 144A ' FRN 25/7/2037	1,758,457	0.02
USD 8,106,373	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE2 Trust ' Series 2007-HE2 2A3 ' FRN 25/4/2037	4,296,552	0.04
USD 868,540	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE2 Trust ' Series 2007-HE2 2A4 ' FRN 25/4/2037	470,432	0.00
USD 522,921	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR2 Trust ' Series 2005-AR2 B1 ' FRN 25/1/2045	362,795	0.00
USD 8,620,003	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust ' Series 2006-AR3 A1B ' FRN 25/2/2046	8,283,742	0.08
USD 608,867	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-0A5 Trust ' Series 2007-0A5 1A ' FRN 25/6/2047	588,711	0.01
USD 1,186,619	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-0A5 Trust ' Series 2007-0A5 2A ' FRN 25/6/2047	1,090,943	0.01
USD 1,021,881	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-1 Trust ' Series 2006-1 4CB ' 6.5% 25/2/2036	926,807	0.01
USD 5,665,131	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust ' Series 2006-4 1A1 ' 6% 25/4/2036	5,260,810	0.05
USD 342,995	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) ' Series 2006-4 3A5 ' 6.35% 25/5/2036	325,901	0.00
USD 1,500,464	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) ' Series 2006-4 3A1 ' 6.5% 25/5/2036	1,425,521	0.01
USD 4,844,060	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-9 Trust (Step-up coupon) ' Series 2006-9 A7 ' 4.587% 25/10/2036	2,461,882	0.02
USD 1,428,145	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-0A1 Trust ' Series 2007-0A1 2A ' FRN 25/12/2046	1,292,579	0.01
USD 4,648,769	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust ' Series 2006-HE4 2A2 ' FRN 25/9/2036	2,142,322	0.02
USD 3,681,857	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust ' Series 2006-HE5 1A ' FRN 25/10/2036	3,030,056	0.03
USD 3,557,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6% 1/2/2023	3,567,369	0.03
USD 1,821,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6.625% 15/8/2025	1,899,148	0.02
USD 1,329,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C27 ' Series 2015-C27 C ' 3.894% 15/2/2048	1,344,749	0.01
USD 600,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 ' Series 2015-NXS4 B ' FRN 15/12/2048	652,007	0.01
USD 443,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 ' Series 2015-NXS4 D ' FRN 15/12/2048	453,149	0.00
USD 480,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-P2 ' Series 2015-P2 D ' ' 144A ' 3.241% 15/12/2048	443,946	0.00
USD 2,760,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 ' Series 2016-BNK1 XD ' ' 144A ' FRN 15/8/2049	189,281	0.00
USD 995,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 ' Series 2016-NXS5 C ' FRN 15/1/2059	1,111,066	0.01
USD 1,856,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 ' Series 2017-C39 D ' ' 144A ' FRN 15/9/2050	1,937,961	0.02
USD 1,940,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 ' Series 2017-C39 C ' 4.118% 15/9/2050	2,092,014	0.02
USD 1,500,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41 ' Series 2017-C41 C ' FRN 15/11/2050	1,645,468	0.02
USD 1,356,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-HSDB ' Series 2017-HSDB A ' ' 144A ' FRN 13/12/2031	1,353,439	0.01
USD 850,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 ' Series 2018-1745 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2036	959,453	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 752,286	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-BXI ' Series 2018-BXI E ' ' 144A ' FRN 15/12/2036	753,629	0.01
USD 332,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 ' Series 2018-C44 D ' ' 144A ' 3% 15/5/2051	305,991	0.00
USD 490,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 ' Series 2018-C45 C ' 4.727% 15/6/2051	543,286	0.01
USD 430,000	WESCO Distribution Inc 5.375% 15/12/2021	431,797	0.00
USD 1,173,000	Wesleyan University 4.781% 1/7/2116	1,597,595	0.02
USD 320,000	West CLO 2013-1 Ltd ' Series 2013-1A C ' ' 144A ' FRN 7/11/2025	321,709	0.00
USD 895,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2020	903,552	0.01
USD 890,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2021	932,751	0.01
USD 975,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2022	1,058,640	0.01
USD 810,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2023	908,755	0.01
USD 860,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2024	996,353	0.01
USD 2,277,000	Western Midstream Operating LP FRN 13/1/2023	2,269,059	0.02
USD 360,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C8 ' Series 2012-C8 C ' FRN 15/8/2045	380,349	0.00
USD 520,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C24 ' Series 2014-C24 B ' FRN 15/11/2047	542,659	0.01
USD 400,000	Whiting Petroleum Corp 1.25% 1/4/2020	338,000	0.00
USD 573,000	William Carter Co/The ' 144A ' 5.625% 15/3/2027	611,576	0.01
USD 2,522,000	William Lyon Homes Inc 6% 1/9/2023	2,623,927	0.03
USD 537,000	William Lyon Homes Inc ' 144A ' 6.625% 15/7/2027	580,147	0.01
EUR 2,250,000	WMG Acquisition Corp 4.125% 1/11/2024	2,557,605	0.02
USD 2,446,000	WPX Energy Inc 4.5% 15/1/2030	2,337,765	0.02
USD 3,854,000	WPX Energy Inc 5.25% 15/9/2024	3,902,136	0.04
USD 532,000	WPX Energy Inc 5.25% 15/10/2027	532,984	0.01
USD 742,000	WPX Energy Inc 5.75% 1/6/2026	751,629	0.01
USD 398,000	WPX Energy Inc 8.25% 1/8/2023	446,920	0.00
USD 950,000	Wyndham Hotels & Resorts Inc ' 144A ' 5.375% 15/4/2026	985,171	0.01
USD 676,000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp ' 144A ' 5.25% 15/5/2027	675,155	0.01
USD 1,353,000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp ' 144A ' 5.5% 1/3/2025	1,358,060	0.01
USD 3,771,000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp ' 144A ' 5.125% 1/10/2029	3,735,194	0.04
USD 1,199,000	Xerox Corp 4.5% 15/5/2021	1,216,409	0.01
USD 134,000	XPO Logistics Inc ' 144A ' 6.125% 1/9/2023	137,797	0.00
USD 1,151,000	XPO Logistics Inc ' 144A ' 6.75% 15/8/2024	1,235,040	0.01
USD 2,029,076	Yale Mortgage Loan Trust 2007-1 ' Series 2007-1 A ' ' 144A ' FRN 25/6/2037	854,751	0.01
USD 1,000,000	York CLO 1 Ltd ' Series 2014-1A BRR ' ' 144A ' FRN 22/10/2029	987,363	0.01
USD 250,000	York CLO 1 Ltd ' Series 2014-1A DRR ' ' 144A ' FRN 22/10/2029	247,366	0.00
USD 250,000	York CLO-2 Ltd ' Series 2015-1A AR ' ' 144A ' FRN 22/1/2031	250,060	0.00
USD 960,000	York Clo-3 Ltd ' Series 2016-1A AR ' ' 144A ' FRN 20/10/2029	960,178	0.01
USD 5,995,000	York Clo-3 Ltd ' Series 2016-1A BR ' ' 144A ' FRN 20/10/2029	5,949,992	0.06
USD 4,240,000	York Clo-3 Ltd ' Series 2016-1A DR ' ' 144A ' FRN 20/10/2029	4,260,515	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,520,000	York Clo-3 Ltd ' Series 2016-1A ER ' ' 144A ' FRN 20/10/2029	1,463,563	0.01
USD 730,000	York Clo-3 Ltd ' Series 2016-1A FR ' ' 144A ' FRN 20/10/2029	647,643	0.01
USD 3,180,000	York Clo-3 Ltd ' Series 2016-1A SUB ' ' 144A ' FRN 20/10/2029	1,827,953	0.02
USD 550,000	York Clo-4 Ltd ' Series 2016-2A A ' ' 144A ' FRN 20/1/2030	550,162	0.01
USD 610,000	York Clo-4 Ltd ' Series 2016-2A D ' ' 144A ' FRN 20/1/2030	610,983	0.01
USD 1,820,000	York Clo-4 Ltd ' Series 2016-2A E ' ' 144A ' FRN 20/1/2030	1,804,420	0.02
USD 2,010,000	York Clo-4 Ltd ' Series 2016-2A SUB ' ' 144A ' FRN 20/4/2032	1,120,054	0.01
USD 327,000	Yum! Brands Inc ' 144A ' 4.75% 15/1/2030	340,904	0.00
USD 2,055,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc (Restricted) 6% 1/4/2023	2,102,953	0.02
USD 1,085,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc (Restricted) 6.375% 15/5/2025	1,111,675	0.01
		5,259,980,900	49.98
ウルグアイ			
USD 4,282,948	Uruguay Government International Bond 4.375% 27/10/2027	4,822,332	0.05
ベトナム			
USD 4,473,000	No Va Land Investment Group Corp 5.5% 27/4/2023	4,271,715	0.04
USD 3,000,000	Vinpearl JSC 3.5% 14/6/2023	3,133,635	0.03
		7,405,350	0.07
債券合計		8,730,896,462	82.95
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている 譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		8,971,439,314	85.24

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通 / 優先株式			
6,200	Bristow Group Inc**	177,630	0.00
5,928	Bristow Group Inc**	169,837	0.00
5,331	Bristow Group Inc (Pref)**	327,963	0.01
1,871	Bristow Group Inc (Pref)**	115,104	0.00
		790,534	0.01
普通 / 優先株式合計		790,534	0.01
債券			
	米国		
USD	2,391 Lehman Brothers Special Finance 31/12/2049 (Zero Coupon)**	-	0.00
USD	8,776,000 One Market Plaza Trust 2017-1MKT ' Series 2017-1MKT XNCP ' ' 144A ' FRN 10/2/2032 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	3,780,000 Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 4/2/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	7,220,000 Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) FRN 1/5/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	3,399,000 Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	630,000 Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	10,740,000 Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 6/11/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
		-	0.00
債券合計		-	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計		790,534	0.01
投資有価証券合計		8,972,229,848	85.25
その他の純資産		1,552,311,567	14.75
純資産合計(米ドル)		10,524,541,415	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

** 注記2(j)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

† 差入れた有価証券または保証として引渡した有価証券。詳細については注記14を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

事後通告証券契約 2020年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD (168,635,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2.5 3/20 ' 2.5% TBA	(170,736,344)	(1.62)
USD 87,272,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3 4/20 ' 3% TBA	89,389,467	0.85
USD (669,011,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3 3/20 ' 3% TBA	(690,806,107)	(6.56)
USD (1,539,435,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3 3/20 ' 3% TBA	(1,578,161,335)	(15.00)
USD 105,979,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3.5 3/20 ' 3.5% TBA	109,667,562	1.04
USD 817,260,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3.5 4/20 ' 3.5% TBA	845,688,798	8.03
USD 618,995,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4 4/20 ' 4% TBA	649,958,677	6.18
USD 359,032,050	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4.5 3/20 ' 4.5% TBA	382,256,918	3.63
USD 99,901,000	Ginnie Mae ' 2.5 3/20 ' 2.5% TBA	101,828,775	0.97
USD 433,467,000	Ginnie Mae ' 3 4/20 ' 3% TBA	445,263,414	4.23
USD 12,114,000	Ginnie Mae ' 3 3/20 ' 3% TBA	12,456,543	0.12
USD (74,468,000)	Ginnie Mae ' 3.5 3/20 ' 3.5% TBA	(76,932,816)	(0.73)
USD 18,182,999	Ginnie Mae ' 4.5 3/20 ' 4.5% TBA	19,124,821	0.18
T B A 合計		138,998,373	1.32

事後通告(以下「T B A」という。)契約は、主にパス・スルー代理人の発行体の所在国により分類される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
BRL	84,458,933	USD	19,952,500	Deutsche Bank	3/3/2020	(1,190,676)
BRL	17,929,834	USD	4,200,500	Morgan Stanley	3/3/2020	(217,542)
BRL	16,586,304	USD	3,920,000	Citibank	3/3/2020	(235,496)
EUR	962,146	USD	1,047,000	Standard Chartered Bank	3/3/2020	8,262
GBP	804,676	USD	1,047,000	Morgan Stanley	3/3/2020	(15,164)
HUF	325,799,178	USD	1,047,000	Bank of America	3/3/2020	9,457
JPY	115,260,858	USD	1,047,000	Morgan Stanley	3/3/2020	16,145
MXN	12,280,998	USD	660,000	Goldman Sachs	3/3/2020	(37,357)
MXN	7,445,413	USD	398,000	Bank of America	3/3/2020	(20,520)
MXN	29,630,177	USD	1,560,000	Citibank	3/3/2020	(57,758)
SEK	10,175,380	USD	1,047,000	Deutsche Bank	3/3/2020	(2,387)
USD	7,372,000	BRL	31,798,490	Morgan Stanley	3/3/2020	308,239
USD	8,118,000	BRL	34,764,488	Citibank	3/3/2020	395,369
USD	15,752,000	BRL	67,505,196	BNP Paribas	3/3/2020	756,303
USD	1,058,000	EUR	974,936	Bank of America	3/3/2020	(11,290)
USD	1,560,000	EUR	1,405,286	BNP Paribas	3/3/2020	18,710
USD	2,220,000	GBP	1,690,556	BNP Paribas	3/3/2020	52,200
USD	398,000	GBP	307,561	Morgan Stanley	3/3/2020	3,614
USD	1,560,000	HUF	474,841,068	BNP Paribas	3/3/2020	20,250
USD	398,000	HUF	123,087,231	UBS	3/3/2020	(1,130)
USD	660,000	HUF	205,231,554	Commonwealth Bank of Australia	3/3/2020	(5,497)
USD	660,000	JPY	72,881,859	Goldman Sachs	3/3/2020	(12,249)
USD	1,958,000	JPY	212,494,009	BNP Paribas	3/3/2020	(2,006)
USD	1,047,000	MXN	19,987,406	Deutsche Bank	3/3/2020	33,644
USD	660,000	SEK	6,460,939	Barclays	3/3/2020	(3,285)
USD	398,000	SEK	3,840,787	Goldman Sachs	3/3/2020	3,702
USD	1,560,000	SEK	15,016,398	BNP Paribas	3/3/2020	18,405
USD	1,047,000	ZAR	15,939,729	Bank of America	3/3/2020	27,934
ZAR	9,874,744	USD	660,000	RBS Plc	3/3/2020	(28,683)
ZAR	5,933,429	USD	398,000	Morgan Stanley	3/3/2020	(18,661)
ZAR	23,485,126	USD	1,560,000	BNP Paribas	3/3/2020	(58,538)
IDR	9,055,886,400	USD	660,000	BNP Paribas	4/3/2020	(29,210)
IDR	5,456,580,000	USD	398,000	Goldman Sachs	4/3/2020	(17,921)
IDR	21,585,720,000	USD	1,560,000	JP Morgan	4/3/2020	(56,442)
INR	159,252,120	USD	2,220,000	JP Morgan	4/3/2020	(13,980)
INR	28,413,220	USD	398,000	Deutsche Bank	4/3/2020	(4,409)
RUB	41,988,408	USD	660,000	Standard Chartered Bank	4/3/2020	(35,207)
RUB	25,344,590	USD	398,000	Goldman Sachs	4/3/2020	(20,869)
RUB	99,997,560	USD	1,560,000	JP Morgan	4/3/2020	(72,024)
USD	39,208,369	EUR	36,148,000	HSBC Bank Plc	4/3/2020	(440,487)
USD	896,873	EUR	821,000	Citibank	4/3/2020	(3,639)
USD	6,143,589	EUR	5,595,000	Goldman Sachs	4/3/2020	6,725
USD	18,558,366	EUR	16,866,000	Morgan Stanley	4/3/2020	58,930

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	5,093,485	EUR	4,597,000	Toronto Dominion	4/3/2020	51,276
USD	857,025,441	EUR	776,088,000	Bank of America	4/3/2020	5,774,981
USD	801,247	GBP	617,000	Citibank	4/3/2020	10,046
USD	230,848,557	GBP	177,044,000	BNP Paribas	4/3/2020	3,818,603
USD	1,047,000	IDR	14,632,243,800	Morgan Stanley	4/3/2020	27,788
USD	1,047,000	INR	75,255,010	BNP Paribas	4/3/2020	4,539
USD	62,269,082	JPY	6,774,845,000	HSBC Bank Plc	4/3/2020	(224,366)
USD	1,047,000	RUB	68,421,241	Morgan Stanley	4/3/2020	28,883
KRW	5,138,758,800	USD	4,242,000	JP Morgan	10/3/2020	(5,356)
USD	3,158,000	CNH	22,033,953	Citibank	10/3/2020	7,225
USD	4,226,000	KRW	5,097,929,450	Morgan Stanley	10/3/2020	23,018
USD	3,158,000	KRW	3,738,724,620	JP Morgan	10/3/2020	75,613
AUD	6,283,000	JPY	462,646,820	Bank of America	13/3/2020	(178,903)
CNH	16,520,000	USD	2,396,985	RBS Plc	13/3/2020	(34,902)
CNH	4,470,000	USD	632,714	BNP Paribas	13/3/2020	6,421
CNH	21,723,466	USD	3,089,793	Bank of America	13/3/2020	16,298
IDR	110,959,152,547	USD	8,085,936	BNP Paribas	13/3/2020	(400,340)
IDR	304,630,632,657	USD	22,127,548	Goldman Sachs	13/3/2020	(1,027,280)
IDR	263,981,562,425	USD	18,741,720	HSBC Bank Plc	13/3/2020	(457,013)
IDR	202,422,570,000	USD	14,204,193	Bank of America	13/3/2020	(183,376)
INR	1,084,240,000	USD	15,111,598	Goldman Sachs	13/3/2020	(134,068)
INR	968,460,000	USD	13,447,221	Bank of America	13/3/2020	(69,059)
INR	313,206,248	USD	4,395,877	BNY Mellon	13/3/2020	(69,293)
INR	531,847,290	USD	7,430,318	BNP Paribas	13/3/2020	(83,459)
JPY	465,314,581	AUD	6,283,000	Standard Chartered Bank	13/3/2020	203,523
JPY	247,273,000	USD	2,289,898	Royal Bank of Canada	13/3/2020	(7,811)
JPY	46,726,865	USD	431,675	Bank of America	13/3/2020	(432)
KRW	13,501,660	USD	11,365	HSBC Bank Plc	13/3/2020	(227)
KRW	1,619,932,156	USD	1,399,895	UBS	13/3/2020	(63,603)
KRW	5,766,459,898	USD	4,974,088	Goldman Sachs	13/3/2020	(217,298)
KRW	5,766,460,000	USD	4,977,952	Bank of America	13/3/2020	(221,163)
MYR	40,800,000	USD	9,766,607	Goldman Sachs	13/3/2020	(92,127)
MYR	6,716,610	USD	1,621,586	Morgan Stanley	13/3/2020	(28,946)
PHP	667,700,000	USD	13,078,565	Citibank	13/3/2020	(4,670)
PHP	292,700,000	USD	5,780,016	Goldman Sachs	13/3/2020	(48,806)
PHP	28,300,000	USD	554,902	HSBC Bank Plc	13/3/2020	(774)
SGD	12,759,749	USD	9,446,139	HSBC Bank Plc	13/3/2020	(302,302)
THB	604,426,883	USD	19,962,395	BNY Mellon	13/3/2020	(803,944)
USD	48,878,581	CNH	344,300,626	Bank of America	13/3/2020	(350,646)
USD	39,237,084	CNH	277,202,149	BNP Paribas	13/3/2020	(398,185)
USD	12,164,362	CNH	85,099,430	Goldman Sachs	13/3/2020	(3,432)
USD	4,883,922	EUR	4,378,503	Bank of America	13/3/2020	78,685
USD	3,771,737	EUR	3,414,000	Standard Chartered Bank	13/3/2020	25,004

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	2,799,679	EUR	2,506,250	Morgan Stanley	13/3/2020	49,167
USD	939,501	HKD	7,337,223	Bank of America	13/3/2020	(1,889)
USD	15,694,581	HKD	122,916,034	Citibank	13/3/2020	(75,955)
USD	11,014,125	IDR	151,406,135,779	BNP Paribas	13/3/2020	526,965
USD	10,037,763	IDR	137,718,084,662	Goldman Sachs	13/3/2020	498,706
USD	7,580,448	IDR	104,109,865,968	Standard Chartered Bank	13/3/2020	369,268
USD	20,072,482	IDR	280,083,075,313	Bank of America	13/3/2020	672,503
USD	31,965,746	IDR	450,469,020,596	HSBC Bank Plc	13/3/2020	763,968
USD	4,355,619	IDR	61,240,000,000	Morgan Stanley	13/3/2020	113,825
USD	52,739,398	INR	3,800,666,187	Bank of America	13/3/2020	237,562
USD	12,420,968	INR	888,846,972	HSBC Bank Plc	13/3/2020	142,568
USD	4,674,237	INR	333,039,412	Citibank	13/3/2020	73,681
USD	4,678,185	INR	333,040,000	JP Morgan	13/3/2020	77,620
USD	10,097,215	INR	723,465,481	Goldman Sachs	13/3/2020	103,371
USD	25,089,416	JPY	2,715,816,368	Bank of America	13/3/2020	25,098
USD	1,363,522	KRW	1,619,932,156	HSBC Bank Plc	13/3/2020	27,230
USD	9,741,351	KRW	11,546,421,558	Bank of America	13/3/2020	216,635
USD	23,319,437	MYR	97,416,949	Goldman Sachs	13/3/2020	219,970
USD	9,970,677	MYR	40,800,000	Morgan Stanley	13/3/2020	296,197
USD	4,605,548	PHP	234,100,000	JP Morgan	13/3/2020	21,755
USD	9,378,293	SGD	12,759,749	Morgan Stanley	13/3/2020	234,457
USD	19,256,422	THB	604,426,883	BNY Mellon	13/3/2020	97,970
USD	2,264,703	TWD	68,575,206	Goldman Sachs	13/3/2020	(3,404)
JPY	4,230,950,000	USD	39,204,503	JP Morgan	16/3/2020	(150,384)
USD	42,233,480	JPY	4,230,950,000	HSBC Bank Plc	16/3/2020	3,179,361
JPY	16,005,433,080	USD	147,280,000	RBS Plc	17/3/2020	467,750
USD	147,280,000	JPY	15,954,562,568	Citibank	17/3/2020	1,841
AUD	4,426,000	CAD	4,036,512	UBS	18/3/2020	(120,668)
AUD	4,169,000	CAD	3,778,370	JP Morgan	18/3/2020	(95,988)
AUD	1,240,000	CAD	1,113,606	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(20,956)
AUD	3,890,000	CAD	3,541,534	Citibank	18/3/2020	(101,483)
AUD	4,230,000	JPY	308,267,485	Citibank	18/3/2020	(91,320)
AUD	4,475,000	JPY	331,047,970	UBS	18/3/2020	(142,081)
AUD	2,237,000	JPY	165,227,280	Deutsche Bank	18/3/2020	(68,627)
AUD	8,280,000	JPY	626,648,349	Bank of America	18/3/2020	(393,213)
AUD	2,633,216	USD	1,741,050	Citibank	18/3/2020	(26,354)
AUD	406,932	USD	271,982	Royal Bank of Canada	18/3/2020	(6,996)
AUD	6,697,650	USD	4,521,312	BNP Paribas	18/3/2020	(159,939)
AUD	64,900,000	USD	44,131,516	Toronto Dominion	18/3/2020	(1,869,966)
AUD	68,814,132	USD	47,032,853	Bank of America	18/3/2020	(2,222,502)
AUD	12,453,096	USD	8,409,904	Deutsche Bank	18/3/2020	(300,702)
AUD	39,532,785	USD	26,650,265	JP Morgan	18/3/2020	(907,327)

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
AUD	2,241,223	USD	1,513,000	RBS Plc	18/3/2020	(53,562)
AUD	37,504,473	USD	25,806,394	Goldman Sachs	18/3/2020	(1,384,249)
AUD	250,639	USD	167,335	Commonwealth Bank of Australia	18/3/2020	(4,124)
AUD	42,722,140	USD	29,623,143	Morgan Stanley	18/3/2020	(1,803,361)
BRL	32,618,889	USD	7,547,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(308,750)
BRL	36,764,838	USD	8,750,011	Citibank	18/3/2020	(591,760)
BRL	2,135,626	USD	500,000	BNP Paribas	18/3/2020	(26,097)
BRL	29,420,000	USD	7,054,751	Barclays	18/3/2020	(526,346)
BRL	43,770,000	USD	10,604,713	Royal Bank of Canada	18/3/2020	(891,992)
BRL	173,894,629	USD	42,462,000	Bank of America	18/3/2020	(3,874,150)
CAD	5,915,316	AUD	6,515,000	Deutsche Bank	18/3/2020	158,010
CAD	2,985,071	AUD	3,320,000	Citibank	18/3/2020	58,699
CAD	3,487,175	AUD	3,890,000	Bank of America	18/3/2020	61,045
CAD	19,260,000	CHF	14,371,253	Toronto Dominion	18/3/2020	(554,636)
CAD	22,785,247	GBP	13,278,000	JP Morgan	18/3/2020	(83,515)
CAD	17,704,000	JPY	1,468,297,837	Deutsche Bank	18/3/2020	(384,642)
CAD	2,260,000	JPY	185,738,552	Royal Bank of Canada	18/3/2020	(33,438)
CAD	7,844,500	JPY	650,315,967	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(167,894)
CAD	13,187,000	JPY	1,101,249,431	BNP Paribas	18/3/2020	(356,417)
CAD	4,495,000	JPY	375,404,280	Citibank	18/3/2020	(121,729)
CAD	2,909,000	JPY	243,566,497	JP Morgan	18/3/2020	(84,488)
CAD	8,720,000	JPY	726,146,377	Morgan Stanley	18/3/2020	(216,640)
CAD	25,976,175	NOK	177,457,279	Morgan Stanley	18/3/2020	605,582
CAD	1,881,000	NOK	12,806,612	Bank of America	18/3/2020	48,442
CAD	1,912,656	NZD	2,213,000	JP Morgan	18/3/2020	41,703
CAD	14,236,310	NZD	16,432,000	Morgan Stanley	18/3/2020	335,268
CAD	4,791,650	NZD	5,533,000	Deutsche Bank	18/3/2020	111,393
CAD	116,744,318	USD	88,765,469	Bank of America	18/3/2020	(1,918,575)
CAD	6,159,196	USD	4,636,875	Deutsche Bank	18/3/2020	(55,007)
CAD	15,686,778	USD	11,819,732	BNP Paribas	18/3/2020	(150,232)
CAD	42,967,989	USD	32,927,315	JP Morgan	18/3/2020	(963,135)
CAD	3,073,583	USD	2,345,013	Royal Bank of Canada	18/3/2020	(58,554)
CAD	20,600,548	USD	15,790,869	Citibank	18/3/2020	(465,980)
CAD	4,162,383	USD	3,157,500	Morgan Stanley	18/3/2020	(61,075)
CHF	3,514,451	EUR	3,240,000	Goldman Sachs	18/3/2020	82,543
CHF	12,008,000	JPY	1,369,331,633	JP Morgan	18/3/2020	(206,156)
CHF	165,000	JPY	18,810,825	Citibank	18/3/2020	(2,787)
CHF	6,639,000	JPY	753,548,408	Deutsche Bank	18/3/2020	(81,396)
CHF	6,912,159	NZD	10,799,440	Bank of America	18/3/2020	418,012
CHF	2,874,554	NZD	4,470,000	JP Morgan	18/3/2020	187,041
CHF	171,313	NZD	265,560	Goldman Sachs	18/3/2020	11,668
CHF	10,958,301	USD	11,197,500	Morgan Stanley	18/3/2020	150,468

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
CHF	10,590,333	USD	10,856,519	Bank of America	18/3/2020	110,396
CHF	6,114,322	USD	6,304,625	Deutsche Bank	18/3/2020	27,116
CHF	4,739,871	USD	4,880,730	Goldman Sachs	18/3/2020	27,686
CHF	27,027,201	USD	27,898,174	JP Morgan	18/3/2020	90,090
CHF	7,666,430	USD	7,894,068	BNP Paribas	18/3/2020	44,972
CHF	2,488,873	USD	2,576,500	UBS	18/3/2020	875
CNH	67,718,392	EUR	8,771,000	Citibank	18/3/2020	52,296
CNH	16,774,470	EUR	2,175,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	10,383
CNH	29,536,617	EUR	3,762,000	Bank of America	18/3/2020	92,665
CNH	172,628,824	USD	24,702,852	Bank of America	18/3/2020	(23,581)
CNH	71,056,413	USD	10,180,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(21,670)
CNH	12,489,807	USD	1,782,470	Barclays	18/3/2020	3,091
COP	18,594,025,000	USD	5,305,000	JP Morgan	18/3/2020	(59,075)
EUR	3,240,000	CHF	3,494,460	Morgan Stanley	18/3/2020	(61,840)
EUR	13,159,000	CNH	101,219,058	BNP Paribas	18/3/2020	(24,444)
EUR	1,549,000	CNH	12,194,348	Morgan Stanley	18/3/2020	(42,826)
EUR	3,192,836	GBP	2,700,274	Goldman Sachs	18/3/2020	41,070
EUR	664,579	GBP	561,730	JP Morgan	18/3/2020	8,964
EUR	13,272,584	GBP	11,237,168	Citibank	18/3/2020	155,129
EUR	5,101,000	MXN	106,246,674	Bank of America	18/3/2020	226,348
EUR	5,975,818	MXN	128,038,324	Morgan Stanley	18/3/2020	84,589
EUR	2,213,182	MXN	47,557,800	Goldman Sachs	18/3/2020	24,349
EUR	4,475,000	MXN	95,601,215	Deutsche Bank	18/3/2020	77,530
EUR	14,750,000	NOK	148,749,325	Goldman Sachs	18/3/2020	502,440
EUR	2,160,000	NOK	21,365,340	JP Morgan	18/3/2020	117,628
EUR	1,305,000	NOK	13,093,369	Deutsche Bank	18/3/2020	51,538
EUR	4,475,000	NOK	46,203,033	Citibank	18/3/2020	39,149
EUR	2,213,000	NZD	3,710,657	Deutsche Bank	18/3/2020	113,614
EUR	28,512,000	NZD	48,030,394	JP Morgan	18/3/2020	1,324,745
EUR	4,265,000	NZD	7,229,590	Bank of America	18/3/2020	170,136
EUR	7,746,000	NZD	13,048,346	RBS Plc	18/3/2020	360,097
EUR	11,444,000	NZD	19,582,439	Morgan Stanley	18/3/2020	341,840
EUR	4,109,000	RUB	286,274,030	Bank of America	18/3/2020	259,338
EUR	16,598,000	SEK	175,164,835	Bank of America	18/3/2020	225,469
EUR	5,763,563	USD	6,314,012	JP Morgan	18/3/2020	13,240
EUR	77,217,244	USD	84,752,959	Citibank	18/3/2020	16,308
EUR	58,810,289	USD	65,188,192	BNP Paribas	18/3/2020	(626,124)
EUR	8,453,503	USD	9,417,751	Deutsche Bank	18/3/2020	(137,475)
EUR	14,715,000	USD	15,994,164	UBS	18/3/2020	159,997
EUR	6,447,000	USD	6,987,708	RBS Plc	18/3/2020	89,824
EUR	107,922,686	USD	119,123,843	Bank of America	18/3/2020	(646,072)
EUR	16,308,947	USD	18,047,591	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(143,592)
EUR	5,755,000	USD	6,430,487	Morgan Stanley	18/3/2020	(112,635)

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
EUR	17,970,972	USD	20,100,000	Goldman Sachs	18/3/2020	(371,426)
EUR	9,300,000	USD	10,379,098	Toronto Dominion	18/3/2020	(169,536)
EUR	2,000	USD	2,180	Royal Bank of Canada	18/3/2020	16
GBP	13,278,000	CAD	22,916,003	Bank of America	18/3/2020	(13,755)
GBP	585,545	EUR	690,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(6,320)
GBP	4,666,896	EUR	5,540,000	Citibank	18/3/2020	(94,920)
GBP	839,554	EUR	1,000,892	Goldman Sachs	18/3/2020	(21,764)
GBP	5,839,943	EUR	6,820,854	BNP Paribas	18/3/2020	3,793
GBP	25,807,641	EUR	30,369,498	RBS Plc	18/3/2020	(232,501)
GBP	1,655,543	EUR	1,948,756	Royal Bank of Canada	18/3/2020	(15,545)
GBP	2,590,000	USD	3,423,773	Goldman Sachs	18/3/2020	(101,204)
GBP	19,376,616	USD	25,319,571	Bank of America	18/3/2020	(462,376)
GBP	200,642	USD	261,490	Commonwealth Bank of Australia	18/3/2020	(4,097)
GBP	5,337,893	USD	6,935,647	BNP Paribas	18/3/2020	(87,957)
GBP	13,199,083	USD	17,192,642	RBS Plc	18/3/2020	(260,265)
GBP	7,079,223	USD	9,207,726	Deutsche Bank	18/3/2020	(126,180)
GBP	13,498,355	USD	17,561,310	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(245,013)
GBP	12,250,141	USD	16,080,000	Toronto Dominion	18/3/2020	(364,968)
GBP	12,701,000	USD	16,490,791	Citibank	18/3/2020	(197,377)
GBP	9,602,660	USD	12,430,748	JP Morgan	18/3/2020	(112,024)
GBP	3,803,000	USD	4,919,066	Morgan Stanley	18/3/2020	(40,407)
IDR	103,270,000,000	USD	7,475,208	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(344,505)
IDR	47,133,000,000	USD	3,385,505	Citibank	18/3/2020	(131,013)
IDR	57,607,000,000	USD	4,136,651	BNP Paribas	18/3/2020	(158,938)
IDR	346,900,000,000	USD	24,464,034	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(510,894)
IDR	297,666,520,000	USD	21,249,388	Goldman Sachs	18/3/2020	(695,777)
INR	1,676,496,992	USD	23,356,046	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(233,064)
INR	1,394,001,843	USD	19,484,144	Bank of America	18/3/2020	(257,459)
INR	1,862,033,157	USD	26,102,133	JP Morgan	18/3/2020	(420,155)
INR	1,015,900,000	USD	14,212,367	Morgan Stanley	18/3/2020	(200,628)
INR	692,413,775	USD	9,675,720	BNY Mellon	18/3/2020	(125,645)
INR	2,147,772,557	USD	29,970,921	Citibank	18/3/2020	(347,899)
INR	2,199,588,668	USD	30,610,077	Barclays	18/3/2020	(272,384)
INR	918,600,000	USD	12,784,969	Goldman Sachs	18/3/2020	(115,234)
INR	320,550,000	USD	4,451,465	BNP Paribas	18/3/2020	(30,299)
JPY	327,354,030	AUD	4,350,000	Royal Bank of Canada	18/3/2020	189,377
JPY	161,993,520	AUD	2,160,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	88,915
JPY	254,201,090	AUD	3,446,000	JP Morgan	18/3/2020	102,723
JPY	161,659,042	AUD	2,237,000	Deutsche Bank	18/3/2020	35,686
JPY	328,944,593	AUD	4,456,000	Citibank	18/3/2020	135,036
JPY	190,292,647	AUD	2,573,000	BNP Paribas	18/3/2020	81,225
JPY	529,038,848	CAD	6,416,000	Bank of America	18/3/2020	110,980

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
JPY	365,261,997	CAD	4,408,000	Standard Chartered Bank	18/3/2020	92,819
JPY	1,327,392,084	CAD	15,931,000	Morgan Stanley	18/3/2020	402,800
JPY	727,975,554	CAD	8,730,000	Citibank	18/3/2020	226,088
JPY	325,193,733	CAD	3,873,000	Deutsche Bank	18/3/2020	120,914
JPY	1,114,873,992	CAD	13,278,000	JP Morgan	18/3/2020	414,499
JPY	212,003,186	CAD	2,529,000	BNP Paribas	18/3/2020	75,793
JPY	1,006,912,708	CHF	8,853,000	Morgan Stanley	18/3/2020	127,632
JPY	748,332,345	CHF	6,639,000	BNP Paribas	18/3/2020	33,243
JPY	377,863,243	CHF	3,320,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	50,234
JPY	407,461,104	NZD	5,655,000	Bank of America	18/3/2020	232,238
JPY	312,314,639	NZD	4,360,000	Morgan Stanley	18/3/2020	162,092
JPY	552,169,342	NZD	7,633,000	Standard Chartered Bank	18/3/2020	333,658
JPY	528,474,464	NZD	7,286,000	JP Morgan	18/3/2020	331,479
JPY	392,422,239	NZD	5,445,000	BNP Paribas	18/3/2020	224,466
JPY	317,076,125	NZD	4,475,000	Citibank	18/3/2020	134,276
JPY	361,163,876	USD	3,320,000	Goldman Sachs	18/3/2020	14,128
JPY	3,069,720,541	USD	28,235,659	Deutsche Bank	18/3/2020	102,836
JPY	1,264,563,412	USD	11,533,145	Citibank	18/3/2020	140,824
JPY	646,742,976	USD	5,923,871	JP Morgan	18/3/2020	46,614
JPY	2,478,743,879	USD	22,894,994	Morgan Stanley	18/3/2020	(12,171)
JPY	29,840,946	USD	269,318	BNP Paribas	18/3/2020	6,162
JPY	34,818,801	USD	317,418	Royal Bank of Canada	18/3/2020	4,015
JPY	1,910,425,391	USD	17,591,300	Bank of America	18/3/2020	45,023
JPY	796,170,155	USD	7,294,800	HSBC Bank Plc	18/3/2020	55,141
KRW	6,065,000,000	USD	5,093,685	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(86,014)
MXN	222,286,715	EUR	10,349,000	Bank of America	18/3/2020	(118,763)
MXN	95,416,845	EUR	4,475,000	Citibank	18/3/2020	(86,855)
MXN	785,605,184	USD	40,781,000	RBS Plc	18/3/2020	(1,048,165)
MXN	636,609,345	USD	33,746,250	Deutsche Bank	18/3/2020	(1,549,041)
MXN	62,600,000	USD	3,218,840	Barclays	18/3/2020	(52,777)
MYR	54,100,000	USD	12,990,131	Barclays	18/3/2020	(165,428)
MYR	30,800,000	USD	7,550,639	Goldman Sachs	18/3/2020	(249,329)
NOK	177,935,038	CAD	25,976,175	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(555,188)
NOK	12,790,360	CAD	1,881,000	Bank of America	18/3/2020	(50,156)
NOK	46,135,831	EUR	4,475,000	JP Morgan	18/3/2020	(46,238)
NOK	57,070,436	EUR	5,593,750	Deutsche Bank	18/3/2020	(121,017)
NOK	142,581,317	EUR	14,119,143	Citibank	18/3/2020	(460,487)
NOK	41,583,597	EUR	4,095,857	State Street	18/3/2020	(110,185)
NOK	66,313,661	NZD	11,187,000	JP Morgan	18/3/2020	12,982
NOK	149,977,793	USD	16,265,410	JP Morgan	18/3/2020	(445,686)
NOK	167,533,037	USD	18,090,607	BNP Paribas	18/3/2020	(419,148)
NOK	148,102,078	USD	16,351,232	Deutsche Bank	18/3/2020	(729,360)

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
NOK	143,670,983	USD	15,454,119	Citibank	18/3/2020	(299,641)
NOK	30,094,405	USD	3,244,000	Morgan Stanley	18/3/2020	(69,629)
NOK	13,460,420	USD	1,450,569	Royal Bank of Canada	18/3/2020	(30,758)
NZD	2,213,000	CAD	1,912,636	JP Morgan	18/3/2020	(41,689)
NZD	16,598,000	CAD	14,337,683	Citibank	18/3/2020	(307,079)
NZD	5,367,000	CAD	4,647,017	Bank of America	18/3/2020	(107,400)
NZD	15,535,000	CHF	9,958,194	JP Morgan	18/3/2020	(616,897)
NZD	9,674,363	EUR	5,593,000	Morgan Stanley	18/3/2020	(102,233)
NZD	41,585,078	EUR	24,465,000	Deutsche Bank	18/3/2020	(904,464)
NZD	169,681	EUR	99,000	Goldman Sachs	18/3/2020	(2,785)
NZD	9,327,939	EUR	5,533,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(252,569)
NZD	22,403,383	EUR	13,278,000	Bank of America	18/3/2020	(594,656)
NZD	5,590,821	EUR	3,320,000	BNP Paribas	18/3/2020	(155,469)
NZD	10,862,799	EUR	6,480,000	JP Morgan	18/3/2020	(334,280)
NZD	3,885,000	JPY	278,972,137	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(150,734)
NZD	4,363,000	JPY	316,770,292	Morgan Stanley	18/3/2020	(201,353)
NZD	22,131,000	JPY	1,601,622,555	Bank of America	18/3/2020	(973,603)
NZD	4,475,000	JPY	314,095,327	Deutsche Bank	18/3/2020	(106,759)
NZD	11,187,000	NOK	65,936,402	Morgan Stanley	18/3/2020	26,812
NZD	14,864,965	USD	9,829,705	Morgan Stanley	18/3/2020	(552,473)
NZD	14,279,274	USD	9,090,345	JP Morgan	18/3/2020	(178,643)
NZD	10,170,792	USD	6,466,449	BNP Paribas	18/3/2020	(118,852)
NZD	7,173,886	USD	4,677,654	Citibank	18/3/2020	(200,428)
NZD	908,027	USD	581,309	Deutsche Bank	18/3/2020	(14,609)
NZD	283,724	USD	181,321	Royal Bank of Canada	18/3/2020	(4,249)
NZD	14,396,572	USD	9,352,787	Bank of America	18/3/2020	(367,878)
NZD	3,322,705	USD	2,156,000	RBS Plc	18/3/2020	(82,298)
NZD	7,874,758	USD	5,177,953	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(263,311)
PHP	98,800,000	USD	1,937,635	BNP Paribas	18/3/2020	(4,909)
RUB	1,955,450,359	USD	30,561,025	Barclays	18/3/2020	(1,520,113)
RUB	386,033,889	USD	6,013,875	Bank of America	18/3/2020	(280,783)
RUB	33,710,000	USD	514,917	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(14,281)
RUB	554,976,676	USD	8,861,875	JP Morgan	18/3/2020	(619,769)
RUB	50,366,867	USD	783,000	Deutsche Bank	18/3/2020	(34,988)
RUB	57,402,139	USD	891,000	Goldman Sachs	18/3/2020	(38,506)
RUB	583,362,162	USD	9,189,061	Citibank	18/3/2020	(525,394)
RUB	169,410,000	USD	2,662,842	Morgan Stanley	18/3/2020	(146,889)
RUB	105,700,198	USD	1,660,000	BNP Paribas	18/3/2020	(90,218)
SEK	175,577,309	EUR	16,598,000	Deutsche Bank	18/3/2020	(183,093)
SEK	32,817,675	USD	3,500,202	Bank of America	18/3/2020	(128,623)
SEK	57,200,393	USD	6,064,083	Deutsche Bank	18/3/2020	(187,505)
SEK	101,936,097	USD	10,680,431	JP Morgan	18/3/2020	(207,855)

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
SEK	47,234,485	USD	4,925,358	BNP Paribas	18/3/2020	(72,644)
SEK	10,955,203	USD	1,119,000	Barclays	18/3/2020	6,501
SEK	11,466,480	USD	1,171,345	UBS	18/3/2020	6,683
SEK	15,802,919	USD	1,615,906	Royal Bank of Canada	18/3/2020	7,633
SEK	96,223	USD	10,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(114)
SEK	9,596	USD	1,000	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(14)
SGD	20,605,000	USD	15,254,262	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(487,913)
SGD	11,540,000	USD	8,542,896	Citibank	18/3/2020	(272,881)
SGD	34,455,000	USD	25,221,359	Goldman Sachs	18/3/2020	(529,559)
SGD	6,315,000	USD	4,685,424	Bank of America	18/3/2020	(159,848)
THB	453,900,000	USD	14,988,889	BNY Mellon	18/3/2020	(600,262)
TWD	78,800,000	USD	2,608,840	Credit Suisse	18/3/2020	(614)
USD	33,732,972	AUD	50,961,879	Citibank	18/3/2020	547,641
USD	35,543,117	AUD	51,591,492	Morgan Stanley	18/3/2020	1,947,796
USD	26,021,467	AUD	37,627,739	Bank of America	18/3/2020	1,519,055
USD	4,328,476	AUD	6,433,459	BNP Paribas	18/3/2020	139,139
USD	4,418,010	AUD	6,504,265	HSBC Bank Plc	18/3/2020	182,566
USD	16,080,000	AUD	22,941,277	Deutsche Bank	18/3/2020	1,141,111
USD	1,668,515	AUD	2,420,000	RBS Plc	18/3/2020	92,661
USD	6,072,452	AUD	8,971,000	JP Morgan	18/3/2020	230,721
USD	39,357,637	AUD	57,740,122	Toronto Dominion	18/3/2020	1,758,454
USD	2,170,702	AUD	3,230,000	UBS	18/3/2020	67,392
USD	6,079,750	AUD	9,052,083	Goldman Sachs	18/3/2020	185,219
USD	3,342,000	BRL	14,236,252	Morgan Stanley	18/3/2020	182,924
USD	2,451,000	BRL	10,382,436	Deutsche Bank	18/3/2020	147,100
USD	500,000	BRL	2,026,300	BNP Paribas	18/3/2020	50,357
USD	2,656,000	BRL	11,227,974	Goldman Sachs	18/3/2020	164,472
USD	5,801,194	BRL	24,840,000	Barclays	18/3/2020	289,108
USD	6,792,038	BRL	28,661,410	Royal Bank of Canada	18/3/2020	431,967
USD	3,510,614	BRL	15,380,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	97,736
USD	4,033,990	BRL	16,744,316	Citibank	18/3/2020	318,365
USD	5,910,000	CAD	7,783,258	Goldman Sachs	18/3/2020	119,981
USD	362,811	CAD	482,538	Toronto Dominion	18/3/2020	3,848
USD	23,274,000	CAD	30,225,920	Bank of America	18/3/2020	788,732
USD	4,621,000	CAD	6,023,850	HSBC Bank Plc	18/3/2020	139,817
USD	473,452	CAD	629,018	Citibank	18/3/2020	5,522
USD	1,674,549	CAD	2,217,131	Morgan Stanley	18/3/2020	25,210
USD	538,635	CAD	713,024	Barclays	18/3/2020	8,211
USD	3,010,889	CAD	3,983,331	Deutsche Bank	18/3/2020	47,662
USD	10,926,269	CAD	14,489,906	JP Morgan	18/3/2020	147,129
USD	43,433,875	CAD	56,633,826	BNP Paribas	18/3/2020	1,303,585

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	1,192,902	CHF	1,162,765	Royal Bank of Canada	18/3/2020	(11,210)
USD	14,840,000	CHF	14,385,451	State Street	18/3/2020	(56,984)
USD	2,234,000	CHF	2,164,461	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(7,428)
USD	25,685,000	CHF	24,794,521	Morgan Stanley	18/3/2020	8,809
USD	2,180,000	CHF	2,122,882	RBS Plc	18/3/2020	(18,369)
USD	9,226,812	CHF	8,974,354	BNP Paribas	18/3/2020	(66,661)
USD	5,948,762	CHF	5,791,739	Bank of America	18/3/2020	(48,925)
USD	7,437,621	CHF	7,263,638	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(84,305)
USD	3,613,684	CHF	3,528,548	Deutsche Bank	18/3/2020	(40,335)
USD	16,048,103	CHF	15,670,628	JP Morgan	18/3/2020	(179,758)
USD	8,050,671	CHF	7,865,914	Citibank	18/3/2020	(94,949)
USD	44,732,886	CNH	309,160,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	534,920
USD	17,544,956	CNH	122,800,000	Goldman Sachs	18/3/2020	(10,712)
USD	4,426,000	CNH	30,506,648	Citibank	18/3/2020	64,725
USD	3,589,200	CNH	24,700,000	BNY Mellon	18/3/2020	58,052
USD	23,344,379	CNH	163,791,947	Bank of America	18/3/2020	(71,557)
USD	29,539,000	CNH	205,781,684	Standard Chartered Bank	18/3/2020	120,149
USD	1,790,000	CNH	12,509,415	Barclays	18/3/2020	1,636
USD	6,875,000	CNH	47,904,947	BNP Paribas	18/3/2020	26,438
USD	2,237,000	CNH	15,728,058	Morgan Stanley	18/3/2020	(11,506)
USD	6,359,000	COP	21,744,800,000	Citibank	18/3/2020	224,147
USD	1,960,000	COP	6,637,500,800	Goldman Sachs	18/3/2020	87,364
USD	5,827,449	EUR	5,260,000	UBS	18/3/2020	53,009
USD	309,152	EUR	281,353	Citibank	18/3/2020	282
USD	9,060,925	EUR	8,233,000	Barclays	18/3/2020	22,719
USD	5,286,007	EUR	4,826,380	HSBC Bank Plc	18/3/2020	(12,404)
USD	4,498,055	EUR	4,040,000	Goldman Sachs	18/3/2020	62,934
USD	101,411,046	EUR	90,360,561	Royal Bank of Canada	18/3/2020	2,213,014
USD	46,836,104	EUR	42,027,417	Morgan Stanley	18/3/2020	698,309
USD	10,848,188	EUR	9,800,000	Commonwealth Bank of Australia	18/3/2020	89,726
USD	111,042,929	EUR	100,850,978	JP Morgan	18/3/2020	328,495
USD	18,233,352	EUR	16,667,980	RBS Plc	18/3/2020	(64,794)
USD	68,901,225	EUR	62,630,269	Bank of America	18/3/2020	145,575
USD	42,656,187	EUR	38,887,000	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(34,051)
USD	137,444,868	EUR	124,724,093	BNP Paribas	18/3/2020	522,472
USD	29,896,109	EUR	27,356,089	State Street	18/3/2020	(135,469)
USD	807,953	EUR	747,382	ANZ	18/3/2020	(12,525)
USD	453,513	GBP	350,470	Standard Chartered Bank	18/3/2020	3,914
USD	4,761,919	GBP	3,680,000	Societe Generale	18/3/2020	41,049
USD	277,308	GBP	214,332	Royal Bank of Canada	18/3/2020	2,353

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	5,172,442	GBP	3,952,678	Barclays	18/3/2020	101,769
USD	10,141,698	GBP	7,822,886	Goldman Sachs	18/3/2020	106,148
USD	17,565,066	GBP	13,550,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	182,516
USD	46,008,452	GBP	35,292,154	Citibank	18/3/2020	734,089
USD	3,540,589	GBP	2,720,000	State Street	18/3/2020	51,251
USD	4,137,382	GBP	3,200,000	RBS Plc	18/3/2020	32,278
USD	6,634,968	GBP	5,086,772	Deutsche Bank	18/3/2020	109,428
USD	3,860,234	GBP	2,982,933	Commonwealth Bank of Australia	18/3/2020	33,593
USD	25,754,524	GBP	19,641,231	Morgan Stanley	18/3/2020	557,869
USD	9,550,770	GBP	7,360,000	UBS	18/3/2020	109,031
USD	19,921,317	GBP	15,305,540	JP Morgan	18/3/2020	286,681
USD	17,956,996	GBP	13,769,562	Bank of America	18/3/2020	292,781
USD	7,820,161	GBP	5,990,000	ANZ	18/3/2020	135,919
USD	14,766,673	GBP	11,331,999	BNP Paribas	18/3/2020	229,476
USD	7,539,767	GBP	5,790,000	BNY Mellon	18/3/2020	112,094
USD	24,076,226	IDR	338,047,202,344	Standard Chartered Bank	18/3/2020	734,364
USD	3,622,165	IDR	49,978,630,000	Bank of America	18/3/2020	171,184
USD	12,300,968	IDR	173,527,450,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	319,050
USD	83,733,712	IDR	1,150,591,526,550	Barclays	18/3/2020	4,286,379
USD	3,593,507	IDR	49,827,570,000	Goldman Sachs	18/3/2020	152,957
USD	19,676,974	IDR	272,304,470,288	Citibank	18/3/2020	874,590
USD	12,033,179	IDR	166,872,000,000	JP Morgan	18/3/2020	510,814
USD	46,180,364	INR	3,311,364,397	Goldman Sachs	18/3/2020	508,573
USD	27,362,153	INR	1,959,785,000	Citibank	18/3/2020	331,938
USD	21,109,584	INR	1,510,334,264	Bank of America	18/3/2020	278,391
USD	1,419,038	INR	101,000,000	JP Morgan	18/3/2020	26,001
USD	123,289,647	INR	8,812,743,968	Morgan Stanley	18/3/2020	1,740,415
USD	31,304,867	INR	2,234,835,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	481,042
USD	3,248,578	JPY	356,201,184	Barclays	18/3/2020	(39,736)
USD	9,447,604	JPY	1,033,732,061	Goldman Sachs	18/3/2020	(95,418)
USD	3,410,000	JPY	374,350,822	Citibank	18/3/2020	(45,864)
USD	6,691,736	JPY	727,341,844	Bank of America	18/3/2020	(22,807)
USD	28,185,661	JPY	3,090,960,965	Morgan Stanley	18/3/2020	(348,916)
USD	7,384,917	JPY	812,315,042	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(114,067)
USD	2,777,162	JPY	303,650,303	BNP Paribas	18/3/2020	(26,022)
USD	762,306	JPY	85,000,000	RBS Plc	18/3/2020	(22,382)
USD	348,654	JPY	38,254,274	Deutsche Bank	18/3/2020	(4,495)
USD	2,350,985	JPY	260,902,336	UBS	18/3/2020	(57,567)
USD	19,293,550	JPY	2,107,604,008	JP Morgan	18/3/2020	(163,051)
USD	2,209,422	KRW	2,570,000,000	Bank of America	18/3/2020	87,458
USD	2,942,786	KRW	3,495,000,000	Barclays	18/3/2020	57,080
USD	6,720,204	KRW	8,000,000,000	BNP Paribas	18/3/2020	114,867
USD	1,089,547	MXN	20,860,000	Bank of America	18/3/2020	34,530
USD	2,225,000	MXN	42,959,695	Deutsche Bank	18/3/2020	52,267

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	6,966,000	MXN	132,033,366	Citibank	18/3/2020	288,269
USD	2,144,448	MXN	41,740,000	JP Morgan	18/3/2020	33,402
USD	680,000	MXN	13,095,320	Morgan Stanley	18/3/2020	17,690
USD	10,729,593	MYR	44,160,000	Goldman Sachs	18/3/2020	261,221
USD	10,029,926	MYR	40,740,000	Morgan Stanley	18/3/2020	372,284
USD	8,701,369	NOK	80,209,237	Deutsche Bank	18/3/2020	240,864
USD	1,387,500	NOK	12,693,313	Barclays	18/3/2020	48,603
USD	1,450,569	NOK	13,351,079	UBS	18/3/2020	42,291
USD	6,918,000	NOK	63,475,568	Morgan Stanley	18/3/2020	222,569
USD	5,335,000	NOK	49,322,785	Goldman Sachs	18/3/2020	132,411
USD	9,557,000	NOK	88,703,433	JP Morgan	18/3/2020	200,523
USD	1,338,680	NOK	12,423,151	Toronto Dominion	18/3/2020	28,281
USD	10,556,500	NOK	94,093,412	Bank of America	18/3/2020	631,486
USD	9,411,310	NOK	87,477,646	Citibank	18/3/2020	184,130
USD	8,524,580	NOK	78,832,300	BNP Paribas	18/3/2020	209,314
USD	3,761,886	NZD	5,805,586	BNP Paribas	18/3/2020	138,616
USD	3,534,558	NZD	5,593,000	Goldman Sachs	18/3/2020	43,964
USD	898,926	NZD	1,390,000	UBS	18/3/2020	31,426
USD	1,670,000	NZD	2,558,760	Standard Chartered Bank	18/3/2020	73,077
USD	15,926,133	NZD	24,567,302	Citibank	18/3/2020	593,668
USD	1,910,703	NZD	2,989,945	Bank of America	18/3/2020	44,677
USD	1,346,588	NZD	2,110,547	Royal Bank of Canada	18/3/2020	29,395
USD	6,857,355	NZD	10,490,733	JP Morgan	18/3/2020	310,082
USD	8,180,903	NZD	12,673,820	Deutsche Bank	18/3/2020	271,166
USD	3,887,331	NZD	5,868,393	HSBC Bank Plc	18/3/2020	224,864
USD	734,485	PHP	37,400,000	BNP Paribas	18/3/2020	2,867
USD	1,202,507	PHP	61,400,000	Citibank	18/3/2020	1,400
USD	59,181,685	RUB	3,759,546,149	JP Morgan	18/3/2020	3,347,667
USD	4,765,627	RUB	304,286,615	Goldman Sachs	18/3/2020	246,585
USD	11,167,073	RUB	727,205,492	Citibank	18/3/2020	367,151
USD	19,236,932	RUB	1,220,226,607	HSBC Bank Plc	18/3/2020	1,115,022
USD	10,790,419	RUB	689,603,545	BNP Paribas	18/3/2020	548,935
USD	12,352,530	RUB	796,567,877	Barclays	18/3/2020	522,489
USD	1,225,000	RUB	80,343,095	Morgan Stanley	18/3/2020	31,803
USD	22,107,285	RUB	1,397,337,275	Bank of America	18/3/2020	1,355,057
USD	2,703,000	SEK	25,951,981	Goldman Sachs	18/3/2020	36,780
USD	835,032	SEK	8,057,764	Royal Bank of Canada	18/3/2020	7,204
USD	3,792,380	SEK	36,180,521	Citibank	18/3/2020	75,314
USD	3,026,311	SEK	28,607,262	Bank of America	18/3/2020	87,296
USD	5,912,337	SEK	55,458,219	Deutsche Bank	18/3/2020	214,744
USD	7,962,640	SEK	76,500,638	BNP Paribas	18/3/2020	103,219
USD	10,090,050	SEK	97,781,268	JP Morgan	18/3/2020	44,327
USD	65,027,960	SGD	88,320,000	HSBC Bank Plc	18/3/2020	1,734,395
USD	14,426,706	THB	453,900,000	BNY Mellon	18/3/2020	38,079

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	1,155,060	TWD	34,400,000	Goldman Sachs	18/3/2020	16,444
USD	1,475,671	TWD	44,400,000	BNP Paribas	18/3/2020	6,062
USD	1,444,778	ZAR	21,107,144	State Street	18/3/2020	98,485
USD	3,426,674	ZAR	52,800,000	Societe Generale	18/3/2020	58,891
USD	7,030,721	ZAR	102,856,738	Morgan Stanley	18/3/2020	470,131
USD	2,827,279	ZAR	41,798,105	RBS Plc	18/3/2020	161,238
USD	4,836,000	ZAR	70,498,714	BNP Paribas	18/3/2020	339,326
USD	5,808,516	ZAR	84,117,845	JP Morgan	18/3/2020	443,163
USD	9,139,433	ZAR	132,193,013	HSBC Bank Plc	18/3/2020	707,665
USD	18,903,666	ZAR	278,406,798	Citibank	18/3/2020	1,145,831
USD	12,185,000	ZAR	183,254,804	UBS	18/3/2020	496,319
USD	4,279,768	ZAR	62,844,491	Goldman Sachs	18/3/2020	271,309
USD	23,569,444	ZAR	346,511,282	Bank of America	18/3/2020	1,467,647
USD	4,345,000	ZAR	63,094,666	Standard Chartered Bank	18/3/2020	320,585
ZAR	537,532,212	USD	36,429,100	Citibank	18/3/2020	(2,143,271)
ZAR	149,073,354	USD	9,975,396	Morgan Stanley	18/3/2020	(466,936)
ZAR	21,714,409	USD	1,450,394	Deutsche Bank	18/3/2020	(65,367)
ZAR	63,475,363	USD	4,382,819	Goldman Sachs	18/3/2020	(334,121)
ZAR	11,500,000	USD	761,237	Barclays	18/3/2020	(27,723)
ZAR	11,960,000	USD	794,063	UBS	18/3/2020	(31,210)
ZAR	46,920,000	USD	3,134,310	Toronto Dominion	18/3/2020	(141,576)
ZAR	108,020,315	USD	7,421,512	Bank of America	18/3/2020	(531,570)
ZAR	19,272,981	USD	1,323,488	BNP Paribas	18/3/2020	(94,185)
ZAR	64,606,295	USD	4,426,000	Standard Chartered Bank	18/3/2020	(305,167)
ZAR	144,339,352	USD	10,070,000	Royal Bank of Canada	18/3/2020	(863,492)
ZAR	39,860,000	USD	2,814,449	RBS Plc	18/3/2020	(272,029)
USD	3,983,283	EUR	3,665,000	RBS Plc	19/3/2020	(40,412)
USD	3,982,829	EUR	3,665,000	BNP Paribas	19/3/2020	(40,867)
MXN	203,746,442	USD	10,605,000	Deutsche Bank	24/3/2020	(310,385)
USD	10,605,000	MXN	200,445,105	Deutsche Bank	24/3/2020	477,190
USD	4,738,385	AUD	7,200,000	JP Morgan	30/3/2020	48,551
USD	3,979,000	COP	13,771,319,000	Citibank	31/3/2020	96,054
USD	3,169,000	BRL	14,021,241	Citibank	2/4/2020	60,972
USD	5,684,426	IDR	82,935,769,796	JP Morgan	2/4/2020	11,661
USD	4,633,287	IDR	66,700,802,387	Bank of America	2/4/2020	70,986
USD	4,633,287	IDR	66,853,700,865	BNP Paribas	2/4/2020	60,528
USD	6,011,855	AUD	9,099,000	State Street	3/4/2020	84,537
USD	5,914,052	AUD	8,997,000	Standard Chartered Bank	3/4/2020	53,180
USD	934,437,711	EUR	849,879,000	UBS	3/4/2020	513,738
USD	229,073,112	GBP	177,488,000	Bank of America	3/4/2020	1,281,197
USD	46,826,654	JPY	5,143,346,000	Goldman Sachs	3/4/2020	(697,668)
IDR	66,979,291,522	USD	4,864,146	Bank of America	15/4/2020	(296,121)
IDR	66,865,937,393	USD	4,863,685	JP Morgan	15/4/2020	(303,391)
IDR	72,082,446,499	USD	5,238,169	BNP Paribas	15/4/2020	(322,106)

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	13,779,898	IDR	201,779,047,950	Bank of America	15/4/2020	18,455
USD	9,477,783	MYR	40,260,000	Goldman Sachs	16/4/2020	(56,751)
KZT	275,061,500	USD	721,000	Citibank	24/4/2020	(15,086)
KZT	274,560,000	USD	715,000	Goldman Sachs	24/4/2020	(10,373)
CNH	39,245,000	USD	5,560,359	Citibank	17/6/2020	36,404
USD	16,032,715	EUR	14,650,000	Morgan Stanley	17/6/2020	(132,089)
USD	7,212,420	EUR	6,534,000	State Street	17/6/2020	2,807
KZT	294,198,795	USD	753,390	RBS Plc	24/7/2020	(20,032)
KZT	278,313,750	USD	715,000	Goldman Sachs	24/7/2020	(21,239)
USD	2,238,437	EUR	1,989,260	UBS	27/11/2020	26,396
未実現純評価益						18,477,668
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	122,665,235	USD	82,330,490	BNY Mellon	13/3/2020	(2,462,337)
USD	94,951	AUD	143,526	BNY Mellon	13/3/2020	1,500
未実現純評価損						(2,460,837)
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	1,507,025,878	USD	1,134,038,261	BNY Mellon	13/3/2020	(12,954,106)
未実現純評価損						(12,954,106)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	203,210,686	USD	208,231,611	BNY Mellon	13/3/2020	2,125,272
USD	2,159,571	CHF	2,110,493	BNY Mellon	13/3/2020	(25,138)
未実現純評価益						2,100,134
ヘッジを使用したオフショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	4,604,912	USD	659,401	BNY Mellon	13/3/2020	(976)
未実現純評価損						(976)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	1,544,478,244	USD	1,688,653,792	BNY Mellon	13/3/2020	6,347,416
USD	19,940,714	EUR	18,351,005	BNY Mellon	13/3/2020	(198,682)
未実現純評価益						6,148,734
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	1,128,480,714	USD	1,459,982,390	BNY Mellon	13/3/2020	(12,518,245)
USD	716,699	GBP	553,296	BNY Mellon	13/3/2020	7,004
未実現純評価益損						(12,511,241)
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	5,941,096	USD	765,162	BNY Mellon	13/3/2020	(2,899)
未実現純評価損						(2,899)

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	46,334,489,722	USD	422,436,975	BNY Mellon	13/3/2020	5,181,943
USD	1,305,562	JPY	143,150,621	BNY Mellon	13/3/2020	(15,569)
未実現純評価益						5,166,374
ヘッジを使用したポーランド・ズロチ建投資証券クラス						
PLN	147,210,345	USD	37,717,696	BNY Mellon	13/3/2020	(416,904)
USD	22,139	PLN	87,648	BNY Mellon	13/3/2020	(70)
未実現純評価損						(416,974)
ヘッジを使用したスウェーデン・クローネ建投資証券クラス						
SEK	1,313,997,895	USD	136,237,792	BNY Mellon	13/3/2020	(1,274,633)
USD	1,167,577	SEK	11,319,900	BNY Mellon	13/3/2020	4,892
未実現純評価損						(1,269,741)
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	129,946,188	USD	93,684,732	BNY Mellon	13/3/2020	(563,219)
USD	15,542	SGD	21,654	BNY Mellon	13/3/2020	24
未実現純評価損						(563,195)
未実現純評価益合計						1,712,941

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済上場先物取引 2020年2月29日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
(261)	AUD	Australian 10 Year Bond	2020年3月	(595,881)
(529)	AUD	Australian 3 Year Bond	2020年3月	(173,198)
2,863	EUR	Euro Schatz	2020年3月	601,677
2,233	EUR	EURO STOXX Bank Index	2020年3月	(1,672,391)
1,308	EUR	EURO STOXX 50 Index	2020年3月	(7,115,926)
324	EUR	Short-Term Euro-BPT	2020年3月	(8,301)
172	EUR	Euro-OAT	2020年3月	133,704
98	EUR	STOXX Europe 600 Index	2020年3月	(252,051)
17	EUR	Dax Index	2020年3月	(866,498)
(272)	EUR	Euro BUXL	2020年3月	(1,597,227)
(660)	EUR	Euro BOBL	2020年3月	(501,474)
(955)	EUR	Euro-BTP	2020年3月	1,321,949
(1,557)	EUR	Euro Bund	2020年3月	(2,719,269)
69	HKD	Hang Seng China Enterprises Index	2020年3月	(198,442)
26	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2020年3月	116,774
2,100	KRW	Korean 3 Year Bond	2020年3月	1,834,804
(651)	KRW	Korean 10 Year Bond	2020年3月	(2,176,177)
429	USD	Russell 2000 E-Mini Index	2020年3月	(4,339,794)
253	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2020年3月	(5,076,504)
95	USD	MSCI Emerging Markets Index	2020年3月	(481,801)
(69)	USD	30 Day Federal Funds	2020年3月	(43,129)
(1,314)	USD	S&P 500 E-Mini Index	2020年3月	21,564,785
1,255	CAD	Canadian 10 Year Bond	2020年6月	1,364,479
329	GBP	Long Gilt	2020年6月	372,977
13,310	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2020年6月	21,661,911
4,711	USD	US Ultra 10 Year Note	2020年6月	11,707,063
1,637	USD	US Ultra Bond (CBT)	2020年6月	12,255,182
(2,158)	USD	US Long Bond (CBT)	2020年6月	(11,598,405)
(4,632)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2020年6月	(9,734,770)
(8,724)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2020年6月	(10,776,757)
851	USD	90 Day Euro \$	2020年12月	1,197,405
(547)	USD	90 Day Euro \$	2021年3月	(2,355,134)
(304)	USD	90 Day Euro \$	2021年12月	(335,617)
132	USD	90 Day Euro \$	2022年6月	226,050
合計				11,740,014

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2020年2月29日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (16,583,472)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	246,111	36,130
CDS	USD 16,583,472	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(86,319)	(58,538)
CDS	JPY 307,692,308	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(26,021)	(33,767)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(15,972)	(21,105)
CDS	EUR (107,914)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(4,248)	(21,259)
CDS	EUR (9,250)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(364)	(1,822)
CDS	USD 23,203,200	ファンドはCDX.NA.HY.30.V5に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2023	(6,568)	(1,071,547)
CDS	USD 66,000,000	ファンドはCDX.NA.IG.31.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2023	(175,769)	(1,153,556)
CDS	USD 19,713,600	ファンドはCDX.NA.HY.31.V3に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2023	(22,357)	(970,926)
CDS	EUR 20,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2024	1,152	(3,110)
CDS	EUR 260,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2024	14,974	(40,432)
CDS	EUR 100,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2024	5,759	(15,551)
CDS	EUR 200,000	ファンドはMatterhorn Telecom SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2024	1,937	(37,551)
CDS	EUR 400,000	ファンドはMatterhorn Telecom SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2024	3,706	(75,101)
CDS	USD 1,398,000	ファンドはWells Fargo & Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2024	11,123	(25,542)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 510,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2024	28,832	31,392
CDS	USD 27,175,500	ファンドはCDX.NA.HY.33.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2024	203,791	(1,290,861)
CDS	EUR 500,000	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2024	2,955	(2,166)
CDS	EUR 1,030,000	ファンドはPeugeot SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2024	12,667	(200,618)
CDS	USD 1,980,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	(3,819)	(29,293)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	39,768	15,277
CDS	JPY 74,812,967	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(5,742)	(5,345)
CDS	JPY 142,719,549	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(7,725)	(10,278)
CDS	JPY 115,384,616	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(9,501)	(12,663)
CDS	USD 1,113,000	ファンドはFrontier Communications Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	376,288	567,264
CDS	USD 475,000	ファンドはFrontier Communications Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	160,590	242,094
CDS	EUR (275,799)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(17,965)	(54,333)
CDS	EUR (3,633)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(252)	(716)
CDS	EUR (36,367)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(2,420)	(7,164)
CDS	EUR (412,016)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(28,585)	(81,168)
CDS	EUR (340,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2024	(13,228)	(88,291)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 700,000	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(18,413)	(5,996)
CDS	USD 500,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(42,620)	(47,573)
CDS	EUR (340,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2024	(8,749)	(88,291)
CDS	USD 856,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(47,370)	(96,508)
CDS	EUR 1,640,000	ファンドはNext Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(23,239)	(6,463)
CDS	USD (1,000,000)	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2024	1,766	187,853
CDS	EUR 200,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	3,487	(19,548)
CDS	USD 340,000	ファンドはHertz Corp/TheIに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	515	(628)
CDS	USD 1,390,000	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	13,242	69,788
CDS	USD (505,000)	ファンドはAmerican Axle & Manufacturing Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2024	(18,494)	26,679
CDS	USD 500,000	ファンドはHertz Corp/TheIに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	34,293	(923)
CDS	EUR 1,030,000	ファンドはSunrise Communications Holdings SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(19,877)	(240,215)
CDS	USD 328,648	ファンドはHertz Corp/TheIに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	27,607	(607)
CDS	USD 329,000	ファンドはHertz Corp/TheIに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	25,052	(607)
CDS	EUR 1,568,000	ファンドはAccor SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	21,586	5,524
CDS	EUR (400,000)	ファンドはNovafives SASに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2024	(33,010)	(69,876)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 521,154	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	21,724	(59,248)
CDS	USD 4,259,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	50,493	7,032
CDS	USD 4,258,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	51,459	7,031
CDS	USD 300,000	ファンドはNetflix Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	3,746	(54,389)
CDS	USD (505,000)	ファンドはAmerican Axle & Manufacturing Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2024	(16,823)	26,679
CDS	USD (1,510,000)	ファンドはPetroleos Mexicanosに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2024	(21,557)	(115,074)
CDS	USD 4,259,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	49,515	7,032
CDS	USD 4,258,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	49,503	7,031
CDS	USD 6,711,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	74,976	11,081
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはAdvanced Micro Devices Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2024	(22,598)	626,147
CDS	USD 8,516,965	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	95,109	14,063
CDS	USD 4,259,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	47,560	7,032
CDS	EUR 21,075,000	ファンドはAkzo Nobel NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	76,519	(595,707)
CDS	USD 4,258,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	48,526	7,031

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 300,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	892	(29,322)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2025	6,142	(3,097)
CDS	EUR 1,390,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(16,698)	(11,101)
CDS	EUR 2,460,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(29,376)	(19,646)
CDS	USD 9,312,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.V5に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2022	(12,238)	(376,943)
CDS	EUR (70,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(6,509)	(13,790)
CDS	EUR (254,908)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(11,783)	(50,217)
CDS	EUR (70,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(6,509)	(13,790)
CDS	EUR (310,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(13,655)	(61,071)
CDS	EUR 274,000	ファンドはLadbrokes Coral Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(5,718)	1,853
CDS	EUR (130,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	15,596	4,688
CDS	USD 750,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(46,585)	(84,557)
CDS	USD 1,789,638	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	1,872	(57,735)
CDS	USD 500,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(29,044)	(56,371)
CDS	EUR 8,259	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	496	(1,284)
CDS	USD (1,852,763)	ファンドは21st Century Fox America Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	(9,688)	55,011

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (303,519)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	77,130	10,946
CDS	EUR 82,588	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	4,964	(12,843)
CDS	EUR 194,081	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	11,665	(30,181)
CDS	USD (1,761,969)	ファンドは21st Century Fox America Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	(12,402)	52,315
CDS	USD 1,801,083	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	545	(58,104)
CDS	EUR 282,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	368	10,825
CDS	EUR 1,900,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	13,280	51,677
CDS	USD (1,085,000)	ファンドはAdvanced Micro Devices Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	(6,073)	226,457
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはHellenic Telecommunications Organisation SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	5,090	(217,417)
CDS	EUR 300,000	ファンドはMatterhorn Telecom SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	1,784	(56,326)
CDS	USD 1,000,000	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	16,527	13,847
CDS	EUR 200,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	5,494	(32,684)
CDS	EUR 1,340,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	21,754	26,053
CDS	USD (335,000)	ファンドはPetroleos Mexicanosに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	(3,611)	(25,530)
CDS	USD 4,259,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	49,515	7,032

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (1,760,308)	ファンドはInternational Business Machines Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	9	48,149
CDS	USD 430,000	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	3,822	5,954
CDS	EUR (206,667)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	1,664	6,207
CDS	EUR (103,333)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	733	3,104
CDS	USD 430,000	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	1,703	5,954
CDS	USD 2,750,000	ファンドはBoeing Co/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	20,804	(31,863)
CDS	EUR 1,070,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	23,633	85,626
CDS	USD 1,030,000	ファンドはHertz Corp/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	28,765	(1,901)
CDS	USD 420,000	ファンドはHess Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	5,784	7,735
CDS	USD (2,112,369)	ファンドはInternational Business Machines Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	(3,969)	57,779
CDS	USD (1,784,953)	ファンドはInternational Business Machines Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	(1,665)	48,823
CDS	EUR 480,000	ファンドはMatterhorn Telecom SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	4,331	(90,121)
CDS	EUR 520,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	15,979	(50,824)
CDS	EUR 500,000	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	3,011	(2,166)
CDS	USD 4,258,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	50,262	7,031

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 970,000	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2024	(638)	5,426
CDS	EUR 600,000	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2024	222	3,356
CDS	USD 3,000,000	ファンドはWestpac Banking Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2020	(20,697)	(22,240)
CDS	USD 300,000	ファンドはTeva Pharmaceutical Industries Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2021	(806)	2,144
CDS	EUR (7,854)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(421)	(1,547)
CDS	EUR (20,750)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(1,003)	(4,088)
CDS	EUR (247,704)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(13,291)	(48,798)
CDS	EUR (78,540)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(4,214)	(15,473)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon Saに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(6,492)	(19,700)
CDS	EUR (253,054)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(17,556)	(49,852)
CDS	EUR 350,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2024	8,982	(54,428)
CDS	EUR 710,000	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2024	(18,645)	(6,082)
CDS	USD (5,648,500)	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2024	348,430	(62,803)
CDS	USD 2,000,000	ファンドはStaples Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2024	13,451	41,250
CDS	USD (8,445,100)	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2024	520,940	(93,898)
CDS	EUR 460,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2024	9,134	(71,534)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (9,322,000)	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2024	575,032	(103,648)
CDS	USD 29,990,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(128,554)	49,518
CDS	USD 4,105,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	21,704	7,565
CDS	USD 1,745,000	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	11,126	(29,238)
CDS	EUR 1,870,000	ファンドはBayerische Motoren Werke AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	9,652	(36,770)
CDS	USD 2,491,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(2,359)	37,605
CDS	USD 6,371,000	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	41,751	(106,749)
CDS	USD 58,180,655	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	307,619	107,219
CDS	USD 1,745,000	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	10,794	(29,238)
CDS	USD 3,495,000	ファンドはWells Fargo & Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	27,460	(63,854)
CDS	USD 4,746,054	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	22,787	(79,522)
CDS	EUR 1,030,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	16,421	20,026
CDS	USD 1,745,000	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	7,405	(29,238)
CDS	USD 300,000	ファンドはNetflix Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	3,007	(54,389)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,030,000	ファンドはArdagh Packaging Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	32,364	(138,301)
CDS	EUR 300,000	ファンドはMonitchem HoldCo 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	9,466	(24,497)
CDS	USD 1,743,500	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	8,211	(29,213)
CDS	USD 2,190,374	ファンドはPhilippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	11,330	(49,281)
CDS	EUR 680,000	ファンドはLadbrokes Coral Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(184)	11,043
CDS	USD 12,105,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(68,610)	19,987
CDS	USD 1,000,000	ファンドはNetflix Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	4,723	(181,297)
CDS	EUR 1,560,000	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(33,378)	162,031
CDS	EUR 410,000	ファンドはUniCredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	18,534	29,670
CDS	EUR (130,000)	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/12/2024	(2,966)	11,957
CDS	EUR (10,000)	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/12/2024	(228)	920
CDS	USD 65,932,500	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(62,450)	995,341
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはUniCredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	22,241	(132,832)
CDS	USD 1,250,000	ファンドはAvnet Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(2,111)	827
CDS	EUR 1,400,000	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(1,039)	44,610

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 2,710,000	ファンドはArcelorMittalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	67,161	(407,711)
CDS	USD 2,000,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	20,502	3,302
CDS	USD 30,346,000	ファンドはPhilippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	51,375	(682,749)
CDS	USD 521,667	ファンドはTesla Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	9,940	21,561
CDS	USD 430,000	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	8,632	5,954
CDS	USD 3,486,000	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	24,826	(58,409)
CDS	USD 6,972,631	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	46,090	(116,829)
CDS	USD 3,437,315	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	22,721	(57,594)
CDS	USD 6,970,000	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	40,367	(116,785)
CDS	EUR 2,080,000	ファンドはStandard Chartered Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	12,885	26,307
CDS	USD 416,923	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	15,447	(47,399)
CDS	USD 51,345,616	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(291,023)	84,779
CDS	EUR (499,681)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2026	36,257	(38,431)
CDS	EUR (700,000)	ファンドはZiggo Bond Co BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/12/2026	40,151	130,888

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (2,261,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Citigroup	17/9/2058	(53,181)	(64,368)
CDS	USD 1,440,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Citigroup	17/9/2058	(8,957)	40,995
CDS	EUR 160,000	ファンドはBoparan Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	11,392	14,283
CDS	EUR 490,000	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2021	(31,422)	(18,183)
CDS	EUR 2,110,000	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2021	1,501	(190,164)
CDS	EUR 1,070,000	ファンドはTUI AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2021	35,995	(18,271)
CDS	EUR 500,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2021	19,268	25,286
CDS	EUR 1,070,000	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2022	(47,913)	(50,097)
CDS	EUR 420,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	18,692	38,046
CDS	EUR 1,680,000	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(57,414)	(80,874)
CDS	EUR (200,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	9,756	9,045
CDS	EUR 188,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	245	7,217
CDS	EUR 456,667	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(6,864)	80
CDS	USD (668,360)	ファンドはCDX.NA.HY.32.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	(13,589)	35,123
CDS	EUR (196,481)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	47,937	7,086
CDS	EUR 470,000	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(7,616)	82

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (1,134,840)	ファンドはCDX.NA.HY.32.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	(23,516)	59,637
CDS	EUR 310,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(10,363)	11,900
CDS	EUR 280,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(2,687)	10,749
CDS	EUR (310,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	39,410	11,180
CDS	EUR 860,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	(26,094)	33,013
CDS	EUR (170,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	41,775	6,131
CDS	EUR (530,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	28,052	19,114
CDS	EUR (480,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	84,036	17,311
CDS	EUR (290,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	41,553	10,459
CDS	EUR 1,140,000	ファンドはMatterhorn Telecom SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	8,215	(214,038)
CDS	EUR (160,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(636)	4,806
CDS	EUR 210,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	17,418	12,926
CDS	EUR (20,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	895	601
CDS	EUR 520,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	18,725	(50,824)
CDS	USD 300,000	ファンドはTesla Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	1,801	12,400
CDS	EUR 770,000	ファンドはMatterhorn Telecom SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	394	(144,569)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 840,000	ファンドはMonitchem HoldCo 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	6,608	(68,590)
CDS	EUR 50,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	520	(4,887)
CDS	EUR 830,000	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	10,846	(150,498)
CDS	EUR 360,000	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	4,704	(65,276)
CDS	EUR (170,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	7,606	5,106
CDS	EUR (20,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(593)	601
CDS	EUR 1,040,000	ファンドはZiggo Bond Co BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	1,732	(185,876)
CDS	EUR 530,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	17,510	(51,801)
CDS	EUR 630,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	20,723	(61,575)
CDS	EUR 2,030,000	ファンドはArdagh Packaging Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	49,176	(272,574)
CDS	EUR (960,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(28,485)	28,835
CDS	EUR (270,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(11,485)	(16,619)
CDS	EUR 1,360,000	ファンドはSunrise Communications Holdings SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	(5,498)	(317,177)
CDS	EUR 670,000	ファンドはMonitchem HoldCo 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	20,115	(54,709)
CDS	EUR (470,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	14,263	14,117

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (270,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(8,011)	8,110
CDS	EUR 200,000	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	(442)	1,119
CDS	EUR 1,560,000	ファンドはUnited Group BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	56,770	(167,007)
CDS	EUR (20,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(80)	601
CDS	EUR (1,370,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 Saに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	41,574	41,149
CDS	EUR (40,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	1,214	1,201
CDS	EUR 490,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	5,098	(47,892)
CDS	EUR 70,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	2,302	(6,842)
CDS	EUR 1,220,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	65,274	(199,373)
CDS	EUR 16,295,000	ファンドはITRAXX.FINSUB.32.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	260,516	459,280
CDS	EUR (2,280,000)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2026	(28,731)	448,140
CDS	EUR (443,750)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2026	6,176	87,220
CDS	EUR (310,000)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(9,959)	62,410
CDS	EUR (530,000)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(27,261)	106,701
CDS	EUR (1,040,000)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(47,276)	(94,606)
CDS	EUR (540,000)	ファンドはZiggo Bond Co BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(23,707)	100,970

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (910,000)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2029	(18,013)	209,744
CDS	USD (645,000)	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/1/2047	71,876	17,382
CDS	USD 3,560,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/9/2058	(65,269)	(24,223)
CDS	USD (670,000)	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	11/5/2063	3,667	(53,277)
CDS	USD 2,812,800	ファンドはCDX.NA.HY.29.V5に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/12/2022	(3,293)	(113,860)
CDS	USD (98,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	7,984	(2,790)
CDS	USD 2,860,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	17/9/2058	(52,909)	(19,460)
CDS	USD 4,473,442	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(24,748)	(26,264)
CDS	USD 1,911,039	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(11,577)	(11,220)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/9/2020	41,190	15,277
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(5,573)	(6,220)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(4,986)	(6,336)
CDS	JPY 96,070,381	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(6,068)	(6,792)
CDS	JPY 87,976,539	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(5,534)	(6,220)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(5,921)	(6,313)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(5,706)	(6,220)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (5,750,000)	ファンドは ITRAXX.ASIA.XJ.IG.24.V1に係る デフォルト・プロテクションを 提供し、1%の固定金利を受け 取る	Goldman Sachs	20/12/2020	204,777	37,452
CDS	JPY 175,953,079	ファンドはMitsui & Co Ltdに係る デフォルト・プロテクション を受け取り、1%の固定金利を 支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(11,566)	(12,627)
CDS	EUR 1,820,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、1%の固 定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(17,733)	(14,534)
CDS	EUR (237,328)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、 1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(21,774)	(46,754)
CDS	EUR (80,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、 1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(7,340)	(15,760)
CDS	EUR 230,000	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、5%の固 定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(6,537)	(35,997)
CDS	EUR 370,000	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、5%の固 定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	(5,394)	(64,423)
CDS	EUR 384,615	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、5%の固 定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	(8,037)	(66,967)
CDS	USD 21,815,000	ファンドはCDX.NA.IG.32.V1に係 るデフォルト・プロテクション を提供し、1%の固定金利を受 け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	72,924	(342,317)
CDS	USD 490,000	ファンドはCDX.NA.HY.32.V2に係 るデフォルト・プロテクション を受け取り、5%の固定金利を 支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	5,597	(25,750)
CDS	USD 875,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、5%の固 定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(59,492)	(86,362)
CDS	USD 800,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、5%の固 定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(54,228)	(78,960)
CDS	EUR (500,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテ クションを提供し、5%の固 定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	45,309	18,032
CDS	USD 825,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、5%の固 定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(55,923)	(81,427)
CDS	USD 894,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、5%の固 定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(74,301)	(85,060)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはCaterpillar Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	(3,455)	(81,638)
CDS	USD 200,000	ファンドはNetflix Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	2,497	(36,259)
CDS	USD 7,682,799	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	99,379	12,685
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	19,697	563,558
CDS	USD 3,841,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	49,684	6,342
CDS	USD (1,961,000)	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	25,052	(60,938)
CDS	USD 4,606,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	57,464	7,605
CDS	EUR 59,695,000	ファンドはITRAXX.EUR.32.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	431,746	(1,136,355)
CDS	EUR 870,000	ファンドはMatterhorn Telecom SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	210	(163,345)
CDS	USD 123,210,035	ファンドはCDX.NA.IG.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	827,615	(1,780,605)
CDS	EUR 200,000	ファンドはMatterhorn Telecom SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	(307)	(37,551)
CDS	EUR (200,000)	ファンドはNovafives SASに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	(11,603)	(34,938)
CDS	EUR 300,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	14,916	(29,322)
CDS	USD 365,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	1,698	(35,436)
CDS	EUR (35,915,000)	ファンドはITRAXX.X0.32.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	(943,836)	3,468,924

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 5,371,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	62,167	8,868
CDS	USD 1,000,000	ファンドはOccidental Petroleum Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	21,329	23,258
CDS	EUR 2,470,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	10,220	(543,060)
CDS	EUR 480,000	ファンドはSynlab Unsecured Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	(20,261)	(78,192)
CDS	EUR 200,000	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	198	(19,548)
CDS	EUR 522,000	ファンドはAccor SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	5,825	1,839
CDS	USD (2,112,370)	ファンドはInternational Business Machines Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	(8,782)	57,779
CDS	USD 7,388,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	(17,689)	111,532
CDS	EUR (210,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	(8,231)	(29,382)
CDS	USD 450,000	ファンドはChesapeake Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	104,675	316,524
CDS	USD 17,979,600	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	(22,326)	2,128,642
CDS	USD 2,680,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	13,554	4,425
CDS	USD (962,009)	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	5,084	(29,894)
CDS	USD (4,494,900)	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	55,775	(532,160)
CDS	EUR 4,200,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	72,707	81,659

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 1,013,250	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	(2,426)	15,296
CDS	EUR 1,170,000	ファンドはITV Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	(11,107)	(233,352)
CDS	EUR 200,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	6,002	(32,684)
CDS	EUR 1,560,000	ファンドはStandard Chartered Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	27,770	19,730
CDS	EUR 670,000	ファンドはAuchan Holdings SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	4,339	28,954
CDS	USD 30,855,121	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	400,602	1,549,158
CDS	USD 645,000	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	17/1/2047	(57,775)	(17,382)
CDS	USD (2,250,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(51,792)	(64,055)
CDS	USD (1,841,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	170,677	(52,411)
CDS	USD (1,129,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	85,385	(32,141)
CDS	USD (220,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	18,330	(6,263)
CDS	EUR 4,100,000	ファンドはLANXESS AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/12/2024	21,773	(66,498)
CDS	EUR 11,875,000	ファンドはLANXESS AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/12/2024	63,062	(192,601)
CDS	USD 810,000	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(769)	(12,359)
CDS	USD 2,700,000	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(2,738)	(41,196)
CDS	USD 16,583,472	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(47,695)	(36,130)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (16,583,472)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	290,136	58,538
CDS	USD 2,385,686	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(15,720)	(17,705)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはNational Australia Bank Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(21,588)	(22,251)
CDS	JPY 75,949,367	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(6,121)	(5,427)
CDS	USD 3,614,314	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(24,092)	(26,823)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(21,182)	(22,494)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(22,089)	(22,264)
CDS	USD 3,450,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(23,822)	(25,869)
CDS	USD 2,130,000	ファンドはChesapeake Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(47,329)	475,705
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(15,678)	(21,105)
CDS	EUR 520,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(6,661)	(30,036)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(7,256)	(10,552)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(7,839)	(10,552)
CDS	USD 525,000	ファンドはHertz Corp/The1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2021	(4,149)	(34,944)
CDS	EUR 540,000	ファンドはTUI AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2021	19,789	(9,221)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 310,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2021	14,016	15,678
CDS	EUR 100,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2021	4,092	5,057
CDS	EUR 470,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(30,255)	(41,344)
CDS	EUR (247,944)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(13,304)	(48,845)
CDS	EUR (80,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(7,520)	(15,760)
CDS	EUR (31,447)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(1,976)	(6,195)
CDS	EUR (210,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(12,505)	(41,370)
CDS	EUR (47,170)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(2,963)	(9,293)
CDS	EUR (4,717)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(296)	(929)
CDS	EUR (7,862)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(422)	(1,549)
CDS	EUR (3,144)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(198)	(619)
CDS	EUR (360,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(1,552)	(70,921)
CDS	EUR (78,616)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(4,218)	(15,488)
CDS	USD 820,000	ファンドはRR Donnelley & Sons Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	8,694	40,889
CDS	EUR 160,000	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(2,012)	(27,858)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 1,644,000	ファンドはKB Homeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(141,232)	(245,907)
CDS	USD 822,410	ファンドはRealogy Group LLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(51,540)	(57,348)
CDS	EUR 490,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	23,729	(76,199)
CDS	USD 250,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(21,761)	(24,675)
CDS	EUR 470,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(559)	18,042
CDS	USD (10,210,000)	ファンドはItaly Buoni Poliennali Del Tesoroに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	(30,310)	(21,833)
CDS	USD 25,099,200	ファンドはCDX.NA.IG.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	152,751	(362,728)
CDS	USD 4,194,000	ファンドはWells Fargo & Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	34,760	(73,260)
CDS	USD (425,000)	ファンドはAdvanced Micro Devices Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	(2,734)	88,704
CDS	EUR 200,000	ファンドはMonitchem HoldCo 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	116	(16,331)
CDS	USD (1,150,000)	ファンドはAdvanced Micro Devices Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	(7,398)	240,023
CDS	USD 521,154	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	21,724	(59,248)
CDS	EUR 750,000	ファンドはUniCredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	18,289	54,275
CDS	USD 1,398,000	ファンドはWells Fargo & Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	11,013	(25,542)
CDS	USD 1,495,000	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(12,742)	31,415
CDS	USD 3,495,000	ファンドはWells Fargo & Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	29,104	(63,854)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 5,894,000	ファンドはQatar Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	3,407	(137,091)
CDS	USD 500,000	ファンドはDISH DBS Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(18,629)	(43,694)
CDS	USD 400,000	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	4,797	5,539
CDS	USD 42,244,860	ファンドはCDX.NA.IG.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	313,246	(610,514)
CDS	USD 500,000	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	29,053	59,196
CDS	EUR 1,300,000	ファンドはAltice France SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	8,169	(167,301)
CDS	EUR 500,000	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	17,005	51,933
CDS	EUR 1,570,000	ファンドはInternational Game Technology Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	63,330	(211,240)
CDS	USD 10,210,000	ファンドはItaly Buoni Poliennali Del Tesoroに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	26,697	225,903
CDS	USD 1,000,000	ファンドはGeneral Electric Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(20,391)	(2,140)
CDS	USD 825,000	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(7,031)	17,336
CDS	USD (507,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	41,148	(14,434)
CDS	USD (35,000)	ファンドはCMBX.NA.10.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/11/2059	2,036	(1,127)
CDS	USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	(10,143)	53,277
CDS	EUR 720,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2020	(8,707)	(5,750)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,020,000	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2021	16,521	11,990
CDS	USD 200,000	ファンドはTeva Pharmaceutical Industries Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2021	(54)	1,912
CDS	USD 1,439,000	ファンドはTransocean Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2022	106,757	214,697
CDS	EUR (330,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	18,184	14,924
CDS	EUR (630,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(31,266)	(124,111)
CDS	EUR 200,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	11,605	(31,102)
CDS	USD 2,820,000	ファンドはLowe's Companies Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(18,815)	(87,200)
CDS	USD 2,785,000	ファンドはAllstate Corp/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	1,482	(88,463)
CDS	USD 2,800,000	ファンドはPfizer Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	2,308	(79,662)
CDS	USD 525,000	ファンドはCaterpillar Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	2,176	(14,287)
CDS	USD 4,540,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	50,722	7,496
CDS	USD 2,610,000	ファンドはCDX.EM.IG.32.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	36,003	159,391
CDS	USD (500,000)	ファンドはPetroleos Mexicanosに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2024	(6,884)	(38,104)
CDS	USD 3,445,000	ファンドはBoeing Co/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	(1,126)	(39,915)
CDS	USD (335,000)	ファンドはPetroleos Mexicanosに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2024	(2,810)	(25,530)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 400,000	ファンドはArdagh Packaging Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	3,809	(53,709)
CDS	USD 521,154	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	23,092	(59,248)
CDS	EUR 1,030,000	ファンドはAuchan Holdings SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	1,576	44,512
CDS	USD 2,260,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	12,214	4,165
CDS	USD 2,065,000	ファンドはBoeing Co/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	6,933	(23,926)
CDS	USD 20,700,000	ファンドはKinder Morgan Inc/DEに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	167,734	(160,222)
CDS	EUR 300,000	ファンドはArdagh Packaging Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	2,857	(40,282)
CDS	EUR 520,000	ファンドはAuchan Holdings SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	5,692	22,472
CDS	USD 20,920,000	ファンドはWilliams Companies Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	188,098	19,925
CDS	EUR 100,000	ファンドはMonitchem HoldCo 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	3,531	(8,166)
CDS	EUR (1,010,000)	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2028	42,335	(57,729)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2028	4,192	(5,716)
CDS	EUR (3,190,000)	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2028	133,713	(182,332)
CDS	USD (6,630,000)	ファンドはCmbx.Na.9.Bbb-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(166,970)	(188,748)
CDS	USD 4,020,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(78,718)	(27,353)
CDS	USD (9,149,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(219,676)	(260,461)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 646,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(18,337)	18,391
CDS	USD 507,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(14,391)	14,434
CDS	USD 3,630,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(66,555)	(24,699)
CDS	USD (2,250,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(52,172)	(64,055)
CDS	USD 2,000,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(36,668)	(13,609)
CDS	USD (700,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(20,555)	(19,928)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Standard Chartered Bank	20/12/2024	34,098	5,529
CDS	USD 1,600,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Standard Chartered Bank	20/12/2024	23,250	24,154
IFS	GBP 9,585,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.4075%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2024	(143,106)	(143,106)
IFS	GBP 19,180,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.505%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2024	(421,526)	(421,526)
IFS	GBP 19,180,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.4475%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2024	(416,504)	(416,504)
IFS	GBP 19,180,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.4215%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2024	(305,737)	(305,737)
IFS	GBP 1,917,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.745%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/8/2029	150,138	150,138
IFS	USD 11,845,000	ファンドはCPURNSA + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.8925%の固定金利を支払う	Bank of America	11/12/2029	(282,368)	(282,368)
IFS	USD 11,845,000	ファンドはCPURNSA + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.9175%の固定金利を支払う	Bank of America	13/12/2029	(316,375)	(316,375)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IFS	GBP 19,180,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.53%の固定金利を受け取る	Bank of America	17/12/2029	586,149	586,149
IFS	GBP 9,585,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.51%の固定金利を受け取る	Bank of America	17/12/2029	260,601	260,601
IFS	GBP 19,180,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.5%の固定金利を受け取る	Bank of America	17/12/2029	489,177	489,177
IFS	GBP 19,180,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.58%の固定金利を受け取る	Bank of America	17/12/2029	748,332	748,332
IFS	GBP 9,585,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.345%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	16/1/2025	(96,285)	(96,285)
IFS	GBP 20,590,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.2975%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	17/2/2025	(62,774)	(62,774)
IFS	EUR 11,800,000	ファンドはCPTFEMU + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.3225%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	18/3/2029	(566,505)	(566,505)
IFS	GBP 1,947,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.725%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	16/8/2029	145,788	145,788
IFS	GBP 1,946,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.71%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	16/8/2029	140,698	140,698
IFS	GBP 9,585,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.4805%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	16/1/2030	210,648	210,648
IFS	EUR 7,700,000	ファンドはCPTFEMU + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.049%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	16/2/2030	(69,485)	(69,485)
IFS	GBP 20,590,000	ファンドはUKRPI + 0 bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.41%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	18/2/2030	128,622	128,622
IFS	GBP 2,000,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.423%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/3/2048	554,950	554,950
IFS	GBP 3,395,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.5325%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	15/11/2046	1,134,557	1,134,557
IRS	MXN 1,750,000,000	ファンドは8.505%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	4/11/2020	944,249	944,249
IRS	MXN 1,402,204,466	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.4837016%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2020	(698)	(698)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 184,220,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの 変動金利を受け取り、 1.5594%の固定金利を支払う	Bank of America	27/3/2021	(854,389)	(854,389)
IRS	USD 184,220,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの 変動金利を受け取り、1.559% の固定金利を支払う	Bank of America	30/3/2021	(854,762)	(854,762)
IRS	CAD 23,215,000	ファンドは1.905%の固定金利 を受け取り、6ヶ月CAD CDOR の変動金利を支払う	Bank of America	9/7/2021	89,319	89,319
IRS	CAD 299,555,000	ファンドは1.9075%の固定金 利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	9/7/2021	1,160,790	1,160,790
IRS	USD 275,700,000	ファンドは2.222%の固定金利 を受け取り、3ヶ月USD LIBOR の変動金利を支払う	Bank of America	1/11/2021	5,407,155	5,407,155
IRS	CAD 8,741,490	ファンドは6ヶ月CAD CDORの 変動金利を受け取り、2.582% の固定金利を支払う	Bank of America	3/12/2021	(142,232)	(142,232)
IRS	DKK 51,543,100	ファンドは0.12%の固定金利 を受け取り、6ヶ月DKK CIBOR の変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2021	59,257	60,058
IRS	SEK 71,693,350	ファンドは0.166%の固定金利 を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2021	12,679	13,299
IRS	USD 6,621,610	ファンドは3ヶ月USD LIBORの 変動金利を受け取り、3%の 固定金利を支払う	Bank of America	7/12/2021	(231,998)	(233,139)
IRS	MXN 1,156,834,467	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取 り、7.4874996%の固定金利を 支払う	Bank of America	14/12/2021	(111,378)	(117,779)
IRS	MXN 934,350,533	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取 り、7.4837016%の固定金利を 支払う	Bank of America	15/12/2021	(102,491)	(102,491)
IRS	USD 90,230,000	ファンドは1日USD LIBORの変 動金利を受け取り、1.27654% の固定金利を支払う	Bank of America	15/12/2021	(841,553)	(841,553)
IRS	USD 90,230,000	ファンドは1日USD LIBORの変 動金利を受け取り、1.28395% の固定金利を支払う	Bank of America	15/12/2021	(852,955)	(852,955)
IRS	USD 79,660,000	ファンドは1日USD LIBORの変 動金利を受け取り、1.40948% の固定金利を支払う	Bank of America	15/12/2021	(923,572)	(923,572)
IRS	CHF 114,451,000	ファンドは-0.62%の固定金利 を受け取り、6ヶ月CHF LIBOR の変動金利を支払う	Bank of America	7/1/2022	270,698	270,698
IRS	NOK 534,210,000	ファンドは6ヶ月NOK NIBORの 変動金利を受け取り、1.9%の 固定金利を支払う	Bank of America	7/1/2022	(249,801)	(249,801)
IRS	CHF 182,004,000	ファンドは-0.62%の固定金利 を受け取り、6ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	8/1/2022	433,077	433,077
IRS	CHF 57,475,000	ファンドは-0.5975%の固定金 利を受け取り、6ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/1/2022	151,206	151,206
IRS	NOK 532,874,000	ファンドは6ヶ月NOK NIBORの 変動金利を受け取り、1.905% の固定金利を支払う	Bank of America	18/1/2022	(251,799)	(251,799)
IRS	HUF 5,752,084,000	ファンドは0.62%の固定金利 を受け取り、6ヶ月HUF BUBOR の変動金利を支払う	Bank of America	7/2/2022	(65,666)	(65,666)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	HUF 5,176,876,000	ファンドは0.63%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	10/2/2022	(56,677)	(56,677)
IRS	HUF 6,634,684,000	ファンドは0.655%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/2/2022	(63,252)	(63,252)
IRS	HUF 5,125,107,000	ファンドは0.6475%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	12/2/2022	(52,383)	(52,383)
IRS	HUF 5,224,813,000	ファンドは0.645%の固定金利を受け取り、6ヶ月HUF BUBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/2/2022	(54,854)	(54,854)
IRS	GBP 41,000,000	ファンドは0.694%の固定金利を受け取り、6ヶ月GBP LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2022	101,366	101,366
IRS	EUR 47,800,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.369%の固定金利を支払う	Bank of America	15/2/2022	(45,964)	(45,964)
IRS	USD 56,650,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.34875%の固定金利を支払う	Bank of America	25/2/2022	(1,511,928)	(1,511,928)
IRS	USD 12,710,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.227%の固定金利を支払う	Bank of America	27/2/2022	(59,958)	(59,958)
IRS	SGD 13,590,000	ファンドは1.375%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2022	59,975	59,975
IRS	SGD 13,700,000	ファンドは1.3865%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2022	62,687	62,687
IRS	SGD 17,090,000	ファンドは1.5075%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2022	107,420	107,420
IRS	USD 30,000,000	ファンドは1.46%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	25/3/2022	309,605	309,605
IRS	USD 12,501,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.68%の固定金利を支払う	Bank of America	25/3/2022	(183,414)	(183,414)
IRS	USD 105,429,934	ファンドは1.209%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/3/2022	568,975	568,975
IRS	USD 105,429,934	ファンドは1.209%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/3/2022	568,975	568,975
IRS	USD 162,060,000	ファンドは2.0267%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	30/3/2022	3,501,816	3,501,816
IRS	USD 76,210,000	ファンドは2.2432%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/4/2022	2,006,348	2,006,348
IRS	MYR 75,156,568	ファンドは2.716%の固定金利を受け取り、3ヶ月MYR KLIB3Mの変動金利を支払う	Bank of America	17/6/2022	73,074	73,074
IRS	USD 319,810,000	ファンドは1.7055%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2022	2,890,629	2,890,629
IRS	MXN 436,014,000	ファンドは7%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBT1IEの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2022	212,163	212,163
IRS	USD 78,000,000	ファンドは1.36%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	22/9/2022	417,101	417,101

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	NOK 38,860,000	ファンドは6ヶ月NOK NIBORの変動金利を受け取り、1.92%の固定金利を支払う	Bank of America	1/11/2022	(41,918)	(41,918)
IRS	USD 69,760,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.5138%の固定金利を支払う	Bank of America	8/2/2023	(2,336,221)	(2,336,221)
IRS	EUR 208,330,000	ファンドは-0.46%の固定金利を受け取り、1日EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/2/2023	303,299	303,299
IRS	EUR 7,600,000	ファンドは-0.333%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	12/2/2023	17,382	17,382
IRS	EUR 102,080,000	ファンドは-0.485%の固定金利を受け取り、1日EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	25/2/2023	118,630	118,630
IRS	USD 54,430,000	ファンドは1.088%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	1/3/2023	286,363	286,363
IRS	USD 13,580,000	ファンドは1.057%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/3/2023	62,950	62,950
IRS	USD 61,670,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.526%の固定金利を支払う	Bank of America	5/3/2023	(2,066,761)	(2,066,761)
IRS	USD 127,580,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.43%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2023	(4,009,363)	(4,007,035)
IRS	USD 324,970,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.7605%の固定金利を支払う	Bank of America	12/7/2023	(2,668,950)	(2,668,950)
IRS	EUR 27,847,350	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.3%の固定金利を支払う	Bank of America	25/7/2023	(71,415)	(71,415)
IRS	EUR 28,990,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.29%の固定金利を支払う	Bank of America	26/7/2023	(80,875)	(80,875)
IRS	JPY 453,000,000	ファンドは0.14%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2023	45,959	45,959
IRS	EUR 12,180,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.4495%の固定金利を支払う	Bank of America	28/9/2023	11,045	11,045
IRS	USD 13,270,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.539%の固定金利を支払う	Bank of America	26/10/2023	(169,744)	(169,744)
IRS	USD 12,740,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.575%の固定金利を支払う	Bank of America	1/11/2023	(171,529)	(171,529)
IRS	CAD 5,366,700	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.62%の固定金利を支払う	Bank of America	3/12/2023	(190,835)	(191,404)
IRS	DKK 31,136,910	ファンドは0.422%の固定金利を受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2023	119,410	121,421
IRS	SEK 43,480,990	ファンドは0.505%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2023	73,038	74,158
IRS	USD 4,084,990	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.992%の固定金利を支払う	Bank of America	7/12/2023	(308,268)	(310,465)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 336,953,207	ファンドは8.39%の固定金利を受け取り、1ヶ月 MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	18/1/2024	1,087,648	1,087,648
IRS	JPY 4,068,000,000	ファンドは-0.004%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/3/2024	253,661	253,661
IRS	NOK 32,830,000	ファンドは6ヶ月NOK NIBORの変動金利を受け取り、1.765%の固定金利を支払う	Bank of America	5/6/2024	(39,931)	(39,931)
IRS	EUR 137,810,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.54%の固定金利を支払う	Bank of America	28/6/2024	(6,262,960)	(6,262,960)
IRS	MXN 146,965,505	ファンドは6.72%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	9/8/2024	48,074	48,074
IRS	MXN 343,311,495	ファンドは6.67%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2024	63,187	71,332
IRS	MXN 278,202,000	ファンドは6.715%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	13/8/2024	82,485	82,485
IRS	USD 17,780,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.12%の固定金利を支払う	Bank of America	31/8/2024	(298,207)	(298,885)
IRS	USD 72,320,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.323%の固定金利を支払う	Bank of America	31/8/2024	(1,208,702)	(1,219,738)
IRS	USD 113,340,000	ファンドは1.568%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	23/9/2024	3,043,152	3,043,152
IRS	MXN 428,445,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.4914992%の固定金利を支払う	Bank of America	8/11/2024	16,740	16,740
IRS	MXN 510,606,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.4950992%の固定金利を支払う	Bank of America	31/12/2024	(14,986)	(14,986)
IRS	CHF 3,484,000	ファンドは-0.6%の固定金利を受け取り、6ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	4/2/2025	29,734	29,827
IRS	MXN 456,252,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.3299996%の固定金利を支払う	Bank of America	10/2/2025	(178,704)	(178,704)
IRS	MXN 229,047,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.2950004%の固定金利を支払う	Bank of America	21/2/2025	(54,413)	(54,413)
IRS	THB 254,317,500	ファンドは0.9585%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2025	56,637	56,637
IRS	THB 716,440,000	ファンドは1.2625%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2025	497,278	497,278
IRS	SGD 8,340,000	ファンドは1.48%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2025	108,390	108,390
IRS	SGD 13,960,000	ファンドは1.487%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2025	184,835	184,835
IRS	SGD 13,780,000	ファンドは1.539%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2025	207,429	207,429

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	HKD 76,408,140	ファンドは1.7415%の固定金利を受け取り、3ヶ月HKD HIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2025	233,886	233,886
IRS	HKD 75,267,720	ファンドは1.7975%の固定金利を受け取り、3ヶ月HKD HIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2025	256,541	256,541
IRS	EUR 1,050,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.175%の固定金利を支払う	Bank of America	18/3/2025	(12,451)	(12,451)
IRS	USD 50,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.33625%の固定金利を支払う	Bank of America	27/4/2025	(3,363,203)	(3,363,203)
IRS	MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	62,408	62,408
IRS	MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	62,408	62,408
IRS	MXN 10,285,479	ファンドは6.27%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/12/2025	(8,834)	(8,834)
IRS	USD 3,246,500	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8885%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2026	(383,426)	(383,426)
IRS	USD 37,770,000	ファンドは1.37%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2027	913,621	908,279
IRS	USD 289,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9025%の固定金利を支払う	Bank of America	14/3/2028	(41,565)	(41,565)
IRS	USD 3,930,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.035%の固定金利を支払う	Bank of America	13/9/2028	(637,004)	(637,004)
IRS	JPY 137,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3535%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2028	(53,581)	(53,581)
IRS	DKK 16,055,880	ファンドは1.026%の固定金利を受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2028	234,212	238,246
IRS	USD 2,188,220	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.06%の固定金利を支払う	Bank of America	7/12/2028	(366,399)	(367,455)
IRS	JPY 863,940,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.1915%の固定金利を支払う	Bank of America	4/1/2029	(228,854)	(228,854)
IRS	JPY 124,920,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.159%の固定金利を支払う	Bank of America	29/1/2029	(29,809)	(29,809)
IRS	USD 67,625,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0035%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2029	(11,198,421)	(11,198,421)
IRS	MXN 290,620,000	ファンドは7.9625%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	24/5/2029	1,219,488	1,219,488
IRS	MXN 148,538,065	ファンドは7.96%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	24/5/2029	621,980	621,980
IRS	MXN 142,081,935	ファンドは7.98%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	24/5/2029	604,967	604,967
IRS	NOK 16,415,000	ファンドは6ヶ月NOK NIBORの変動金利を受け取り、1.8595%の固定金利を支払う	Bank of America	5/6/2029	(49,975)	(49,975)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	CHF 2,278,000	ファンドは-0.592%の固定金利を受け取り、6ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	5/9/2029	(5,922)	(5,922)
IRS	EUR 2,010,000	ファンドは0.0605%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/11/2029	58,234	58,234
IRS	MXN 548,050,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.4874996%の固定金利を支払う	Bank of America	6/11/2029	24,818	24,818
IRS	USD 33,035,000	ファンドは1.7395%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	8/11/2029	1,950,246	1,950,246
IRS	USD 34,460,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.44%の固定金利を支払う	Bank of America	15/11/2029	(1,111,497)	(1,103,090)
IRS	USD 2,820,000	ファンドは1.51%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	3/2/2030	106,940	106,940
IRS	USD 11,320,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.6155%の固定金利を支払う	Bank of America	10/2/2030	(543,445)	(543,445)
IRS	USD 1,417,000	ファンドは1.456%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	24/2/2030	46,526	46,526
IRS	USD 1,418,000	ファンドは1.46%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	24/2/2030	47,102	47,102
IRS	USD 2,835,000	ファンドは1.47%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	24/2/2030	96,883	96,883
IRS	USD 2,835,000	ファンドは1.381%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	25/2/2030	72,766	72,766
IRS	USD 2,835,000	ファンドは1.385%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	25/2/2030	73,851	73,851
IRS	USD 5,670,000	ファンドは1.419%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	25/2/2030	166,147	166,147
IRS	USD 2,817,500	ファンドは1.2875%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/2/2030	47,330	47,330
IRS	USD 2,817,500	ファンドは1.292%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/2/2030	48,543	48,543
IRS	USD 5,635,000	ファンドは1.31%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/2/2030	106,794	106,794
IRS	USD 2,812,500	ファンドは1.2525%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/2/2030	37,862	37,862
IRS	USD 11,260,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.3%の固定金利を支払う	Bank of America	27/2/2030	(202,784)	(202,784)
IRS	USD 3,300,000	ファンドは1.234%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/3/2030	39,091	39,091
IRS	USD 8,270,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.25%の固定金利を支払う	Bank of America	2/3/2030	(110,642)	(110,642)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	SGD 5,430,000	ファンドは1.681%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2030	150,753	150,753
IRS	SGD 3,635,000	ファンドは1.6975%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2030	104,996	104,996
IRS	SGD 4,370,000	ファンド1.7%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2030	126,968	126,968
IRS	SGD 3,635,000	ファンドは1.705%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2030	106,849	106,849
IRS	USD 18,949,639	ファンドは1.28%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/3/2030	316,469	316,469
IRS	USD 17,500,000	ファンドは1.6615%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2030	937,615	937,615
IRS	USD 10,220,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.685%の固定金利を支払う	Bank of America	23/9/2031	(501,053)	(501,053)
IRS	USD 1,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.63%の固定金利を支払う	Bank of America	28/9/2032	(37,522)	(37,522)
IRS	JPY 287,470,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.355%の固定金利を支払う	Bank of America	4/2/2034	(145,972)	(145,972)
IRS	JPY 255,240,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.336%の固定金利を支払う	Bank of America	14/3/2034	(124,000)	(124,000)
IRS	USD 4,760,000	ファンドは1.785%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	23/9/2034	202,765	202,765
IRS	USD 5,720,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.982%の固定金利を支払う	Bank of America	7/11/2034	(343,605)	(343,605)
IRS	USD 11,640,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.0915%の固定金利を支払う	Bank of America	12/11/2034	(815,010)	(815,010)
IRS	USD 9,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.757%の固定金利を支払う	Bank of America	12/2/2035	(346,801)	(346,801)
IRS	USD 22,900,000	ファンドは1.562%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2036	1,152,097	1,144,968
IRS	JPY 224,900,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.6165%の固定金利を支払う	Bank of America	14/12/2038	(229,300)	(229,300)
IRS	USD 3,480,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.9151%の固定金利を支払う	Bank of America	21/9/2039	(143,642)	(143,642)
IRS	USD 6,370,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.1225%の固定金利を支払う	Bank of America	15/11/2039	(375,526)	(375,526)
IRS	JPY 163,330,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.715%の固定金利を支払う	Bank of America	21/3/2044	(175,447)	(175,447)
IRS	JPY 150,180,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.2005%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2044	(15,007)	(15,007)
IRS	USD 8,060,000	ファンドは1.627%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/11/2045	626,539	622,064

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	CAD 1,209,350	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.91%の固定金利を支払う	Bank of America	3/12/2048	(278,811)	(279,116)
IRS	EUR 848,220	ファンドは1.46%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	4/12/2048	362,827	362,844
IRS	GBP 633,820	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.732%の固定金利を支払う	Bank of America	4/12/2048	(229,044)	(228,181)
IRS	DKK 6,224,970	ファンドは1.5325%の固定金利を受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2048	347,491	347,834
IRS	SEK 9,027,580	ファンドは1.681%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2048	290,211	291,502
IRS	USD 947,380	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.152%の固定金利を支払う	Bank of America	7/12/2048	(437,507)	(438,391)
IRS	USD 4,960,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.3375%の固定金利を支払う	Bank of America	5/7/2049	(373,958)	(373,958)
IRS	USD 1,460,000	ファンドは1.7645%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	12/12/2049	179,026	179,026
IRS	JPY 232,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.428%の固定金利を支払う	Bank of America	9/1/2050	(198,067)	(198,067)
IRS	USD 1,810,000	ファンドは1.955%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	10/1/2050	310,117	310,117
IRS	USD 4,460,000	ファンドは1.8115%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	10/2/2050	601,523	601,523
IRS	USD 3,500,000	ファンドは1.709%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	12/2/2050	380,289	380,289
IRS	USD 12,850,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.3405%の固定金利を支払う	Bank of America	15/6/2050	(3,489,216)	(3,489,216)
IRS	USD 930,000	ファンドは3.0335%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/2/2053	398,305	398,305
IRS	THB 843,232,550	ファンドは1.2%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	18/3/2022	238,053	238,053
IRS	MYR 72,942,540	ファンドは2.6575%の固定金利を受け取り、3ヶ月MYR KLIB3Mの変動金利を支払う	BNP Paribas	17/6/2022	57,256	57,256
IRS	MYR 73,388,178	ファンドは2.7%の固定金利を受け取り、3ヶ月MYR KLIB3Mの変動金利を支払う	BNP Paribas	17/6/2022	65,989	65,989
IRS	BRL 129,930,000	ファンドは5.42%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/1/2023	174,939	174,939
IRS	MYR 30,429,792	ファンドは3ヶ月MYR KLIB3Mの変動金利を受け取り、2.72%の固定金利を支払う	BNP Paribas	17/6/2025	(61,464)	(61,464)
IRS	MXN 279,950,277	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.71%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/11/2026	(818,829)	(818,829)
IRS	MYR 31,088,000	ファンドは3ヶ月MYR KLIB3Mの変動金利を受け取り、2.68%の固定金利を支払う	Citibank	17/6/2025	(49,096)	(49,096)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MYR 31,163,040	ファンドは3ヶ月MYR KLIB3Mの 変動金利を受け取り、2.695%の 固定金利を支払う	Citibank	17/6/2025	(54,364)	(54,364)
IRS	BRL 208,927,551	ファンドは5.32%の固定金利を 受け取り、1日BRL BROISの変動 金利を支払う	Citigroup	2/1/2023	55,561	55,561
IRS	BRL 157,333,389	ファンドは5.39%の固定金利を 受け取り、1日BRL BROISの変動 金利を支払う	Citigroup	2/1/2023	110,662	110,662
IRS	BRL 33,964,991	ファンドは6.09%の固定金利を 受け取り、1日BRL BROISの変動 金利を支払う	Citigroup	2/1/2025	31,326	31,326
IRS	BRL 64,351,074	ファンドは8.67%の固定金利を 受け取り、1日BRL BROISの変動 金利を支払う	Citigroup	2/1/2025	2,394,219	2,394,219
IRS	INR 263,091,250	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変 動金利を受け取り、5.065%の固 定金利を支払う	Citigroup	18/3/2025	(28,593)	(28,593)
IRS	INR 493,296,094	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変 動金利を受け取り、5.12%の固 定金利を支払う	Citigroup	18/3/2025	(70,088)	(70,088)
IRS	MYR 43,818,900	ファンドは3ヶ月MYR KLIB3Mの 変動金利を受け取り、2.609%の 固定金利を支払う	Citigroup	17/6/2025	(34,933)	(34,933)
IRS	MYR 30,429,792	ファンドは3ヶ月MYR KLIB3Mの 変動金利を受け取り、2.714%の 固定金利を支払う	Citigroup	17/6/2025	(59,453)	(59,453)
IRS	MXN 86,921,000	ファンドは6.325%の固定金利を 受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIE の変動金利を支払う	Citigroup	17/7/2025	(55,471)	(55,471)
IRS	MXN 274,683,000	ファンドは6.02%の固定金利を 受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIE の変動金利を支払う	Citigroup	24/3/2026	(430,712)	(430,712)
IRS	MXN 718,125,534	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIE の変動金利を受け取り、 7.4874996%の固定金利を支払う	Credit Suisse	15/12/2020	830	830
IRS	USD 25,040,000	ファンドは1.3565%の固定金利 を受け取り、3ヶ月USD LIBORの 変動金利を支払う	Credit Suisse	28/9/2021	120,727	120,727
IRS	EUR 33,660,000	ファンドは-0.456%の固定金利 を受け取り、1日EUR EURIBORの 変動金利を支払う	Credit Suisse	8/12/2021	56,567	57,859
IRS	USD 191,755,000	ファンドは1日USD LIBORの変動 金利を受け取り、1.305%の固定 金利を支払う	Credit Suisse	15/12/2021	(1,870,374)	(1,881,521)
IRS	EUR 10,447,500	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの 変動金利を受け取り、-0.45%の 固定金利を支払う	Credit Suisse	16/12/2021	3,057	3,057
IRS	EUR 311,170,000	ファンドは-0.43232%の固定金 利を受け取り、1日EUR EURIBOR の変動金利を支払う	Credit Suisse	4/1/2022	619,814	620,769
IRS	EUR 44,360,000	ファンドは-0.2975%の固定金利 を受け取り、6ヶ月EUR EURIBOR の変動金利を支払う	Credit Suisse	16/1/2022	122,605	123,249
IRS	USD 100,470,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変 動金利を受け取り、2.459%の固 定金利を支払う	Credit Suisse	28/2/2022	(2,935,893)	(2,935,893)
IRS	USD 45,756,000	ファンドは1.742%の固定金利を 受け取り、3ヶ月USD LIBORの変 動金利を支払う	Credit Suisse	16/6/2022	786,548	786,548
IRS	USD 4,240,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変 動金利を受け取り、1.451%の固 定金利を支払う	Credit Suisse	1/12/2022	(51,422)	(51,422)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 5,695,000	ファンドは-0.2618%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	9/1/2023	29,837	29,668
IRS	EUR 186,651,733	ファンドは-0.39931%の固定金利を受け取り、1日EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	28/1/2023	384,916	402,332
IRS	EUR 104,160,000	ファンドは-0.44995%の固定金利を受け取り、1日EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	8/2/2023	466,544	472,138
IRS	EUR 18,330,000	ファンドは-0.4135%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/3/2023	8,990	8,990
IRS	EUR 53,120,000	ファンドは-0.545%の固定金利を受け取り、1日EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/3/2023	24,714	25,142
IRS	USD 13,570,000	ファンドは0.9775%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/3/2023	41,691	41,691
IRS	USD 13,570,000	ファンドは0.9855%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/3/2023	43,826	43,826
IRS	USD 12,720,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.5955%の固定金利を支払う	Credit Suisse	1/11/2023	(176,363)	(176,363)
IRS	EUR 20,370,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.17%の固定金利を支払う	Credit Suisse	13/12/2023	(102,335)	(102,335)
IRS	EUR 10,855,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.052%の固定金利を支払う	Credit Suisse	3/1/2024	(82,639)	(82,639)
IRS	EUR 10,855,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.059%の固定金利を支払う	Credit Suisse	3/1/2024	(80,939)	(80,939)
IRS	GBP 25,620,000	ファンドは0.832%の固定金利を受け取り、6ヶ月GBP LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	7/11/2024	432,675	432,675
IRS	EUR 4,580,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.173%の固定金利を支払う	Credit Suisse	11/11/2024	(53,192)	(53,192)
IRS	USD 48,010,000	ファンドは3.0855%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	29/11/2024	4,720,054	4,720,054
IRS	USD 41,590,000	ファンドは2.5155%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	28/2/2025	3,123,947	3,123,947
IRS	HKD 76,028,000	ファンドは1.8525%の固定金利を受け取り、3ヶ月HKD HIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	18/3/2025	285,069	285,069
IRS	HKD 77,860,000	ファンドは1.866%の固定金利を受け取り、3ヶ月HKD HIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	18/3/2025	298,458	298,458
IRS	HKD 76,028,000	ファンドは1.87%の固定金利を受け取り、3ヶ月HKD HIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	18/3/2025	293,322	293,322
IRS	USD 9,709,506	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.4695%の固定金利を支払う	Credit Suisse	18/3/2025	(237,910)	(237,910)
IRS	USD 5,200,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.5635%の固定金利を支払う	Credit Suisse	18/3/2025	(151,336)	(151,336)
IRS	USD 4,863,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.612%の固定金利を支払う	Credit Suisse	18/3/2025	(153,071)	(153,071)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 9,564,588	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.6135%の固定金利を支払う	Credit Suisse	18/3/2025	(301,763)	(301,763)
IRS	USD 9,661,200	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.6485%の固定金利を支払う	Credit Suisse	18/3/2025	(321,360)	(321,360)
IRS	USD 9,894,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.654%の固定金利を支払う	Credit Suisse	18/3/2025	(331,766)	(331,766)
IRS	USD 9,661,200	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.656%の固定金利を支払う	Credit Suisse	18/3/2025	(324,906)	(324,906)
IRS	USD 4,938,000	ファンドは1.147%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	17/6/2025	46,946	46,946
IRS	MXN 128,100,000	ファンドは8.72%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Credit Suisse	3/1/2029	859,454	859,454
IRS	USD 5,370,000	ファンドは1.7835%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	7/1/2030	342,813	342,813
IRS	USD 5,400,000	ファンドは1.713%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	8/1/2030	308,757	308,757
IRS	CAD 2,010,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.065%の固定金利を支払う	Credit Suisse	9/1/2030	(88,391)	(88,391)
IRS	EUR 9,150,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.185%の固定金利を支払う	Credit Suisse	16/1/2030	(388,734)	(387,013)
IRS	USD 9,310,000	ファンドは1.737%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	23/1/2030	553,960	553,960
IRS	USD 5,400,000	ファンドは1.6815%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	28/1/2030	292,907	292,907
IRS	USD 5,400,000	ファンドは1.567%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	29/1/2030	234,782	234,782
IRS	USD 5,340,000	ファンドは1.5925%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	30/1/2030	244,690	244,690
IRS	USD 2,830,000	ファンドは1.569%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	11/2/2030	123,337	123,337
IRS	USD 762,500	ファンドは1.495%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	12/2/2030	27,876	27,876
IRS	USD 2,822,500	ファンドは1.523%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	12/2/2030	110,724	110,724
IRS	USD 2,822,000	ファンドは1.4935%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	20/2/2030	102,781	102,781
IRS	USD 1,411,500	ファンドは1.5065%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	20/2/2030	53,162	53,162

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 5,610,000	ファンドは1.2315%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/3/2030	65,112	65,112
IRS	USD 9,925,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.748%の固定金利を支払う	Credit Suisse	9/7/2030	(613,488)	(613,488)
IRS	JPY 211,250,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3714%の固定金利を支払う	Credit Suisse	30/1/2045	(84,409)	(84,409)
IRS	USD 3,440,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.705%の固定金利を支払う	Credit Suisse	16/8/2049	(93,964)	(93,964)
IRS	GBP 4,590,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.064%の固定金利を支払う	Credit Suisse	7/11/2049	(614,332)	(614,332)
IRS	JPY 231,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3795%の固定金利を支払う	Credit Suisse	10/1/2050	(166,677)	(166,677)
IRS	JPY 231,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.401%の固定金利を支払う	Credit Suisse	10/1/2050	(180,409)	(180,409)
IRS	JPY 232,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.429%の固定金利を支払う	Credit Suisse	10/1/2050	(198,722)	(198,722)
IRS	USD 3,880,000	ファンドは1.7875%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	7/5/2050	503,771	503,771
IRS	USD 420,000	ファンドは1.9125%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	1/12/2056	59,710	59,710
IRS	MXN 253,592,767	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、7.105%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	(166,465)	(166,465)
IRS	MXN 193,289,233	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、7.11%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	(128,073)	(128,073)
IRS	MXN 336,807,890	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、6.3072%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/8/2025	233,869	233,869
IRS	MXN 414,800,000	ファンドは7.481%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2027	972,491	972,491
IRS	THB 328,650,000	ファンドは1.3775%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	18/3/2030	440,814	440,814
IRS	USD 18,949,639	ファンドは1.28%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	27/3/2030	316,469	316,469
IRS	INR 1,524,300,000	ファンドは5.3825%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	18/3/2022	225,706	225,706
IRS	BRL 8,497,537	ファンドは12.4%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	968,936	968,936
IRS	BRL 252,970,158	ファンドは5.35%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	113,760	113,760

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 28,035,808	ファンドは8.195%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	695,994	695,994
IRS	BRL 26,757,858	ファンドは8.26%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	671,804	671,804
IRS	BRL 21,530,833	ファンドは8.375%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	589,966	589,966
IRS	BRL 29,228,390	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	1,408,454	1,408,454
IRS	BRL 6,194,622	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	298,506	298,506
IRS	BRL 51,000,707	ファンドは6.025%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2025	10,913	10,913
IRS	INR 3,670,959,921	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、4.855%の固定金利を支払う	JP Morgan	18/3/2025	69,189	69,189
IRS	INR 613,879,585	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、4.985%の固定金利を支払う	JP Morgan	18/3/2025	(36,893)	(36,893)
IRS	INR 610,045,900	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、5.348%の固定金利を支払う	JP Morgan	18/3/2025	(171,143)	(171,143)
IRS	BRL 71,963,017	ファンドは6.72%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2025	618,416	618,416
IRS	INR 615,627,171	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、5.31%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	18/3/2025	(158,502)	(158,502)
IRS	JPY 2,018,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.176%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	6/3/2029	(516,253)	(516,253)
IRS	THB 150,870,000	ファンドは0.886%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Nomura	18/3/2022	12,884	12,884
IRS	CHF 50,710,000	ファンドは6ヶ月CHF LIBORの変動金利を受け取り、0.75%の固定金利を支払う	UBS	21/2/2023	(28,915)	(28,915)
IRS	CHF 50,390,000	ファンドは0.655%の固定金利を受け取り、6ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	UBS	20/2/2024	47,523	47,523
IRS	MXN 144,525,723	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.64%の固定金利を支払う	UBS	18/11/2026	(394,511)	(394,511)
TRS	USD (4,500)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 5bpsを受け取り、Caterpillar Inc + Obpsを支払う	BNP Paribas	12/6/2020	59,374	59,374
TRS	USD 6,000,000	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを受け取り、IBOXX US Dollar Liquid High Yield + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/6/2020	(140,024)	(153,217)
TRS	USD (1,294)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 25bpsを受け取り、Charter Communications Inc + Obpsを支払う	BNP Paribas	5/8/2020	33,786	33,786

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	USD (2,566)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 10bpsを受け取り、Charter Communications Inc + 0bpsを支 払う	BNP Paribas	26/8/2020	57,222	57,222
TRS	USD (9,260)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、Tidewater Inc + 0bpsを支払う	BNP Paribas	29/9/2020	62,412	62,412
TRS	USD (10,523)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、Tidewater Inc + 0bpsを支払う	BNP Paribas	29/9/2020	70,925	70,925
TRS	USD (1,850)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 25bpsを受け取り、Belden Inc + 0bpsを支払う	BNP Paribas	8/10/2020	27,916	27,916
TRS	USD (142,229)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 65bpsを受け取り、EQT Corp + 0bpsを支払う	BNP Paribas	12/2/2021	(50,875)	(50,875)
TRS	USD (284,458)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 65bpsを受け取り、EQT Corp + 0bpsを支払う	BNP Paribas	12/2/2021	101,608	101,608
TRS	USD 1,000	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを受け取り、Simon Property Group REIT Inc + 0bpsを支払う	Citibank	30/6/2020	(12,998)	(12,998)
TRS	USD (26,093)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 650bpsを受け取り、Cheapsake Energy Corp + 0bpsを支払う	Citibank	5/11/2020	9,360	9,360
TRS	USD (207,292)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 40bpsを受け取り、 Southwestern Energy Co + 0bps を支払う	Citibank	5/11/2020	109,865	109,865
TRS	USD (155,521)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 650bpsを受け取り、Cheapsake Energy Corp + 0bpsを支払う	Citibank	5/11/2020	55,785	55,785
TRS	USD (568,916)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 350bpsを受け取り、 Chesapeake Energy Corp + 0bps を支払う	Citibank	12/2/2021	139,100	139,100
TRS	USD (115,790)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 15bpsを受け取り、EQT Corp + 0bpsを支払う	Citibank	15/2/2021	(79,582)	(79,582)
TRS	USD (63,560)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 52bpsを受け取り、Intelsat SA + 0bpsを支払う	Credit Suisse	11/6/2020	148,095	148,095
TRS	USD (148,066)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 40bpsを受け取り、Antero Resources Corp + 0bpsを支払う	Credit Suisse	5/11/2020	85,878	85,878
TRS	USD (15,889)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	(2,701)	(2,701)
TRS	USD (13,798)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	(2,346)	(2,346)
TRS	USD (5,243)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	(891)	(891)
TRS	USD (9,195)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	(1,563)	(1,563)
TRS	USD (8,290)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	(1,409)	(1,409)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	USD (21,927)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 125bpsを受け取り、Quorum Health Corp + 0bpsを支払う	JP Morgan	11/6/2020	(3,728)	(3,728)
TRS	USD 16,000,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid High Yield + 0bpsを受 け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/6/2020	(352,724)	(389,429)
TRS	USD (22,000)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 20bpsを受け取り、Commscope Holding Inc + 0bpsを支払う	Merrill Lynch	6/11/2020	39,160	39,160
合計					7,194,134	(6,491,230)

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IFS: インフレーション・スワップ

IRS: 金利スワップ

TRS: トータル・リターン・スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建オプション 2020年2月29日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
8,949,000	コール	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 0.9775	4/3/2020	(1,067)	4,303
703,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.15	5/3/2020	(99,586)	684
27,967,000	プット	OTC USD NOK	Bank of America	USD 9.23	6/3/2020	(96,142)	12,090
9,256,000	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 64.3	6/3/2020	(132,839)	1,466
111,646,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 99	11/3/2020	(357,467)	135
6,374,000	プット	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 15.05	11/3/2020	(36,205)	8,535
66,392,000	プット	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 0.91	12/3/2020	(98,168)	225
15,431,432	コール	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 15.5	24/3/2020	77,800	355,010
1,620,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.2	30/3/2020	(74,094)	3,318
15,662,000	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 62.5	2/4/2020	(68,161)	11,700
11,187,000	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 60	2/4/2020	(5,902)	643
42,336,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 103.5	6/4/2020	(333,272)	82,891
14,451,000	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 62.5	9/4/2020	(127,703)	14,682
8,430,000	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 62.5	10/4/2020	(50,801)	8,884
1,311,000	プット	OTC CAD/JPY	Bank of America	CAD 80	13/4/2020	9,784	10,985
10,990,000	プット	OTC CAD/JPY	Bank of America	CAD 80	15/4/2020	83,769	94,672
16,440,000	コール	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 20.75	15/4/2020	(416,198)	86,191
27,664,000	プット	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6.7	16/4/2020	(12,716)	3,052
996,000	プット	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6.7	16/4/2020	(75,942)	11,377
52,566,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.1537	23/4/2020	1,397,811	2,886,176
3,747,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 106.75	27/4/2020	12,109	30,991
58,330,000	コール	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.689	28/4/2020	(149,148)	39,642
905,000	コール	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 1	29/4/2020	15,447	60,697
39,551,000	コール	OTC EUR/GBP	Bank of America	EUR 0.86	11/5/2020	306,336	472,192
660,000	プット	OTC EUR/CHF	Bank of America	EUR 1.155	25/5/2020	(86,606)	23
654,000	プット	OTC EUR/CHF	Bank of America	EUR 1.155	25/5/2020	(85,459)	23
664,200	プット	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6.7	12/6/2020	(58,145)	21,559
29,193,000	プット	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6.9	3/7/2020	(128,318)	129,135
11,710,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.115	23/7/2020	101,695	265,161
660,000	プット	OTC EUR/CHF	Bank of America	EUR 1.17	25/8/2020	(88,563)	1,849
654,000	プット	OTC EUR/CHF	Bank of America	EUR 1.17	25/8/2020	(87,542)	1,832
4,540,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 106	21/12/2020	64,957	107,860
4,540,000	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 114	21/12/2020	(24,125)	21,548
31,323,000	プット	OTC USD/CNH	Barclays	USD 6.92	16/4/2020	(25,757)	78,486
6,041,000	プット	OTC USD/NOK	BNP Paribas	USD 9.35	3/3/2020	(9,204)	4,086
697,000	プット	OTC USD/TRY	BNP Paribas	USD 5.72	9/3/2020	(104,141)	1,106
82,991,000	プット	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.26	10/3/2020	(84,651)	-
10,605,000	コール	OTC USD/IDR	BNP Paribas	USD 14,000	23/3/2020	331,481	399,352
7,715,716	コール	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 17	24/3/2020	1,450	12,637
17,498,000	プット	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 61	9/4/2020	(184,030)	4,948
18,811,000	コール	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 7.1	6/5/2020	(145,853)	71,414
15,930,000	プット	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 6.9	3/7/2020	(71,776)	69,205
15,065,000	プット	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 6.85	21/7/2020	(49,565)	50,166
20,111,000	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.8	5/3/2020	833,244	952,804
5,579,250	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.8	5/3/2020	224,884	264,330

買建オプション 2020年2月29日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
9,292,000	プット	OTC USD/BRL	Citibank	USD 4.14	6/3/2020	(174,179)	-
320,000	コール	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.71	11/3/2020	(44,467)	2
22,131,000	コール	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.71	17/3/2020	(50,744)	-
7,715,716	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17	24/3/2020	(2,293)	12,637
14,635,000	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 15.6	8/4/2020	68,889	357,025
8,580,000	プット	OTC USD/BRL	Citibank	USD 4	9/4/2020	(149,167)	254
14,570,000	プット	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.9	9/4/2020	(105,268)	25,016
7,150,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 14.5	9/4/2020	(145,657)	9,033
108,180,000	コール	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.705	17/4/2020	(368,930)	8,803
14,872,000	プット	OTC USD/RUB	Citibank	USD 65.3	24/4/2020	(94,909)	109,507
9,756,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 107	1/5/2020	1,641	92,011
49,794,000	コール	OTC AUD/JPY	Citibank	AUD 80	18/5/2020	(42,765)	2,188
7,662,000	プット	OTC CAD/MXN	Citibank	CAD 14.2893	19/5/2020	80	28,786
6,393,000	プット	OTC EUR/MXN	Citibank	EUR 22.658	22/12/2020	(43,114)	144,266
6,393,000	プット	OTC EUR/RUB	Citibank	EUR 73.441	22/12/2020	(183,731)	-
8,401,000	プット	OTC USD/KRW	Deutsche Bank	USD 1,175	4/3/2020	(36,342)	68
13,939,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 3.98	6/3/2020	(11,109)	-
13,885,000	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 62.5	6/3/2020	(42,499)	30
22,374,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 112	24/3/2020	(33,811)	4,918
7,317,500	コール	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 14.65	31/3/2020	378,853	500,126
8,401,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 4.2	2/4/2020	(90,460)	4,270
29,267,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 107	2/4/2020	(111,004)	180,934
33,560,000	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 61	2/4/2020	(3,112)	5,982
8,401,000	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 63	3/4/2020	(55,529)	9,923
12,172,000	コール	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 14.75	8/4/2020	45,983	106,953
3,770,000	コール	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 14.75	8/4/2020	100,634	241,828
8,580,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 4	9/4/2020	(78,579)	254
15,931,000	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 62.5	10/4/2020	(83,290)	16,789
20,820,000	プット	OTC CAD/JPY	Deutsche Bank	CAD 80	13/4/2020	156,338	174,457
11,065,000	プット	OTC CAD/JPY	Deutsche Bank	CAD 82	13/4/2020	147,549	200,678
10,623,000	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 65.3	24/4/2020	(55,458)	13,538
820,000	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.15	5/3/2020	(184,346)	3
1,930,500	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 100	16/3/2020	(175,042)	9,756
72,360,000	コール	OTC EUR/GBP	Goldman Sachs	EUR 0.861	16/7/2020	851,153	1,288,746
1,130,349	プット	OTC EUR/CHF	Goldman Sachs	EUR 1.17	23/7/2020	(99,442)	964
1,030,000	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.05	13/8/2020	(17,139)	107,528
171,861,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 102	11/3/2020	(1,155,702)	12,610
25,819,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 102	11/3/2020	(184,057)	1,894
2,290,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 99	11/3/2020	(159,183)	3,149
738,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 99	11/3/2020	(53,597)	1,015
22,130,667	プット	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.82	12/3/2020	(64,178)	908
5,533,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 102	16/3/2020	(21,502)	1,202
13,424,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 109	17/3/2020	95,037	148,867
11,065,000	プット	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.85	16/4/2020	(19,564)	12,247
75,034,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 106.75	27/4/2020	131,006	620,603

買建オプション 2020年2月29日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
11,066,000	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 7.25	6/5/2020	(4,982)	17,993
11,065,000	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 7.25	6/5/2020	(14,947)	17,991
10,228,000	プット	OTC CAD/MXN	HSBC Bank Plc	CAD 15.0413	19/5/2020	9,805	206,977
17,899,200	プット	OTC USD/MXN	HSBC Bank Plc	USD 18.8	22/5/2020	(69,797)	40,320
8,484,000	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,215	6/3/2020	(26,246)	21,383
14,431,000	プット	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 7	9/4/2020	(5,864)	95,314
599,000	プット	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.73	14/4/2020	(62,033)	8,050
72,080,000	プット	OTC EUR/NOK	JP Morgan	EUR 9.9	29/4/2020	(138,246)	45,148
19,014,000	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.1067	29/4/2020	20,055	286,629
39,551,000	コール	OTC EUR/GBP	JP Morgan	EUR 0.88	11/5/2020	108,850	186,163
20,542,000	コール	OTC EUR/GBP	JP Morgan	EUR 0.86	11/5/2020	145,742	245,247
21,720,000	コール	OTC EUR/CHF	JP Morgan	EUR 1.13	18/5/2020	(36,301)	1,610
1,190,000	プット	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.7	3/7/2020	(118,403)	47,900
131,799,000	プット	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1.0825	17/3/2020	(509,511)	277,743
8,491,228	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 108	18/3/2020	2,531,413	3,040,887
2,735,020	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 108.5	20/3/2020	1,064,653	1,254,737
10,130,000	プット	OTC USD/TRY	Morgan Stanley	USD 5.6	3/4/2020	(90,416)	1,565
10,123,000	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 19	8/4/2020	(116,634)	18,670
769,000	プット	OTC CAD/JPY	Morgan Stanley	CAD 80	15/4/2020	150,680	202,329
72,310,438	コール	OTC EUR/GBP	Morgan Stanley	EUR 0.861	11/5/2020	474,110	824,696
20,542,000	コール	OTC EUR/GBP	Morgan Stanley	EUR 0.855	14/5/2020	222,936	313,462
1,130,000	プット	OTC EUR/CHF	Morgan Stanley	EUR 1.17	19/5/2020	(85,443)	1
55,327,000	プット	OTC EUR/NOK	Royal Bank of Canada	EUR 9.5	6/3/2020	(58,521)	-
15,927,000	プット	OTC USD/JPY	Royal Bank of Canada	USD 102	16/3/2020	(42,409)	3,461
1,988,000	プット	OTC USD/CNH	Standard Chartered Bank	USD 6.7	16/6/2020	(62,071)	176,489
302,726,792	プット	OTC EUR/USD	UBS	EUR 1.085	8/5/2020	281,081	1,726,837
46,500	コール	Starbucks Corp	Citibank	USD 92.5	20/3/2020	(123,474)	8,354
413	プット	2 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98.25	12/6/2020	(85,854)	7,744
75	コール	Acadia Healthcare Co Inc	Exchange Traded	USD 40	20/3/2020	(3,465)	375
30	コール	Acadia Healthcare Co Inc	Exchange Traded	USD 35	20/3/2020	(2,436)	2,250
3,150	コール	Altice Europe NV	Exchange Traded	EUR 7	19/6/2020	(104,283)	46,641
60	コール	Amazon.com Inc	Exchange Traded	USD 2,400	15/5/2020	(113,773)	31,950
104	プット	Atlantia SpA	Exchange Traded	EUR 17	19/6/2020	10,865	53,440
334	プット	Casino Guichard Perrachon SA	Exchange Traded	EUR 32	20/3/2020	(10,364)	18,133
274	プット	Caterpillar Inc	Exchange Traded	USD 110	20/3/2020	58,227	71,925
980	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 20	18/3/2020	(54,194)	31,850
152	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 15	18/3/2020	(3,694)	760
682	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 16	15/4/2020	(31,508)	17,050
134	プット	Commscope Holding Co Inc	Exchange Traded	USD 11	20/3/2020	5,132	12,395
302	コール	Dax Index	Exchange Traded	EUR 14,000	20/3/2020	(139,251)	2,318
112	コール	Dax Index	Exchange Traded	EUR 13,600	20/3/2020	(68,038)	860

買建オプション 2020年2月29日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
134	プット	Discovery Inc	Exchange Traded	USD 25	17/4/2020	16,162	25,795
466	プット	Eldorado Resorts Inc	Exchange Traded	USD 50	15/1/2021	257,372	484,640
1,117	プット	Euro Bund	Exchange Traded	EUR 171.5	27/3/2020	(289,845)	147,012
1,448	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4,000	20/3/2020	(35,101)	3,176
759	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,900	20/3/2020	(152,959)	2,081
425	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,950	20/3/2020	(31,344)	1,864
272	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,600	20/3/2020	(228,046)	29,385
225	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,800	20/3/2020	(77,955)	987
172	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,700	17/4/2020	(59,792)	11,696
2,911	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 105	20/3/2020	(132,814)	15,964
1,456	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 105	19/6/2020	(92,392)	23,954
1,860	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 99.75	13/12/2021	101,593	430,125
380	プット	Exxon Mobil Corp	Exchange Traded	USD 52	6/3/2020	124,754	156,750
100	プット	First Quantum Minerals Ltd	Exchange Traded	CAD 10	20/3/2020	7,601	9,559
333	コール	Freeport-McMoRan Inc	Exchange Traded	USD 17	19/6/2020	(12,985)	1,332
271	コール	Intel Corp	Exchange Traded	USD 75	20/3/2020	(11,380)	813
134	コール	Intel Corp	Exchange Traded	USD 70	20/3/2020	(7,631)	402
1,240	プット	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF	Exchange Traded	USD 104	20/3/2020	260,152	317,440
1,240	プット	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF	Exchange Traded	USD 100.5	20/3/2020	(67,208)	69,440
182	コール	Las Vegas Sands Corp	Exchange Traded	USD 72.5	20/3/2020	(22,484)	2,730
225	コール	Lions Gate Capital Holdings LLC	Exchange Traded	USD 15	20/3/2020	(20,945)	2,250
221	コール	Lions Gate Capital Holdings LLC	Exchange Traded	USD 12.5	20/3/2020	(8,953)	2,210
134	コール	Lions Gate Capital Holdings LLC	Exchange Traded	USD 12.5	19/6/2020	(10,211)	2,010
62	コール	Lions Gate Capital Holdings LLC	Exchange Traded	USD 15	19/6/2020	(2,990)	992
30	コール	Lions Gate Capital Holdings LLC	Exchange Traded	USD 14	19/6/2020	(546)	690
1,470	コール	Lowe's Cos Inc	Exchange Traded	USD 125	17/4/2020	(455,259)	99,225
134	コール	Mylan NV	Exchange Traded	USD 22.5	17/4/2020	(4,153)	5,025
139	プット	Netflix Inc	Exchange Traded	USD 330	20/3/2020	89,899	109,462
39	プット	Netflix Inc	Exchange Traded	USD 300	20/3/2020	8,300	14,040
134	コール	NXP Semiconductors NV	Exchange Traded	USD 155	20/3/2020	(8,737)	2,144
134	コール	NXP Semiconductors NV	Exchange Traded	USD 150	20/3/2020	(10,211)	670
98	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,325	20/3/2020	(204,907)	8,575
96	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,200	20/3/2020	2,774,562	3,146,880

買建オプション 2020年2月29日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
49	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,375	20/3/2020	2,255,713	2,456,125
47	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,050	20/3/2020	824,131	980,655
47	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,025	20/3/2020	785,748	913,915
29	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,500	20/3/2020	(10,612)	435
26	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,425	20/3/2020	(10,132)	845
19	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,450	20/3/2020	(21,506)	713
236	プット	Simon Property Group Inc	Exchange Traded	USD 130	20/3/2020	215,333	243,080
303	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 305	2/3/2020	(47,912)	3,485
3,036	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 310	4/3/2020	5,841,040	6,938,778
6,515	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 335	20/3/2020	(1,998,953)	58,635
3,337	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 340	20/3/2020	(314,549)	18,353
1,880	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 342	20/3/2020	(168,636)	10,340
1,031	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 331	20/3/2020	(207,124)	13,403
307	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 320	20/3/2020	(50,312)	16,885
15,839	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 345	31/3/2020	(2,687,403)	95,034
15,839	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 346	17/4/2020	(3,501,100)	174,229
2,348	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 323	17/4/2020	(1,035,774)	219,538
1,825	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 320	17/4/2020	(876,607)	239,075
1,822	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 315	17/4/2020	(671,361)	420,882
1,214	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 337	17/4/2020	(263,044)	26,101
909	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 345	17/4/2020	(230,143)	9,999
2	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 340	17/4/2020	(358)	34
902	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 328	19/6/2020	(174,138)	170,478
304	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 335	30/6/2020	(97,080)	37,392
400	プット	Sprint Corp	Exchange Traded	USD 8.5	20/3/2020	3,320	7,800
2,803	コール	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Exchange Traded	USD 50	17/4/2020	153,604	1,135,215
2,971	プット	Telecom Italia SpA	Exchange Traded	EUR 0.46	20/3/2020	39,762	74,946
50	プット	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	Exchange Traded	USD 6	20/3/2020	(3,258)	200
550	プット	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	Exchange Traded	USD 5	19/6/2020	(37,711)	3,850
160	プット	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	Exchange Traded	USD 9	19/6/2020	2,230	7,760

買建オプション 2020年2月29日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
224	プット	Uber Technologies Inc	Exchange Traded	USD 27	20/3/2020	6,733	17,920
135	プット	Uber Technologies Inc	Exchange Traded	USD 22	20/3/2020	(5,967)	2,835
65	プット	Uber Technologies Inc	Exchange Traded	USD 36	20/3/2020	28,441	34,287
139	プット	Uber Technologies Inc	Exchange Traded	USD 33	17/4/2020	30,969	51,430
104	プット	Uber Technologies Inc	Exchange Traded	USD 30	17/4/2020	13,350	23,036
4,110	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 127	27/3/2020	(909,009)	-
119	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 132	27/3/2020	271,288	319,812
83	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 128.5	27/3/2020	(36,797)	939
67	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 128	27/3/2020	(15,282)	1,047
174	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 133	24/4/2020	205,001	373,828
25	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 130	22/5/2020	(1,796)	4,883
134	コール	Walt Disney Co/The	Exchange Traded	USD 155	20/3/2020	(8,469)	536
134	コール	Walt Disney Co/The	Exchange Traded	USD 160	17/4/2020	(13,762)	1,541
227	コール	Wynn Resorts Ltd	Exchange Traded	USD 150	20/3/2020	(35,052)	4,313
350	コール	Xilinx Inc	Exchange Traded	USD 125	20/3/2020	(19,320)	2,450
223	コール	Xilinx Inc	Exchange Traded	USD 95	20/3/2020	(9,968)	7,025
134	コール	Xilinx Inc	Exchange Traded	USD 120	19/6/2020	(2,098)	6,365
合計						(267,017)	40,745,225

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建オプション 2020年2月29日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(8,949,000)	プット	OTC GBP/USD	Bank of America	GBP 1.3	3/3/2020	(128,852)	(161,326)
(8,949,000)	コール	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 0.97	4/3/2020	7,536	(17,700)
(4,475,000)	コール	OTC USD/NOK	Bank of America	USD 9.325	6/3/2020	(61,665)	(79,834)
(55,934,000)	プット	OTC USD/NOK	Bank of America	USD 9.17	6/3/2020	97,748	(11,323)
(13,885,000)	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 62.5	6/3/2020	54,260	(30)
(6,374,000)	コール	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 15.5	11/3/2020	(85,357)	(111,108)
(22,131,000)	コール	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.71	17/3/2020	29,704	-
(15,431,432)	コール	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 17	24/3/2020	40,077	(25,274)
(33,560,000)	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 61	2/4/2020	40,633	(5,982)
(42,336,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 100	6/4/2020	152,499	(6,684)
(5,269,000)	コール	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 66	10/4/2020	(137,209)	(167,243)
(7,746,000)	プット	OTC CAD/JPY	Bank of America	CAD 82	13/4/2020	(79,817)	(140,484)
(16,598,000)	プット	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6.85	16/4/2020	25,613	(18,372)
(39,551,000)	コール	OTC EUR/GBP	Bank of America	EUR 0.88	11/5/2020	(140,925)	(186,163)
(61,527,000)	プット	OTC USD/CNH	Barclays	USD 6.85	16/4/2020	11,699	(68,102)
(8,422,000)	プット	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 6.97	6/3/2020	25,014	(11,622)
(14,431,000)	プット	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 7	9/4/2020	19,788	(95,314)
(3,047,000)	プット	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 61	9/4/2020	25,769	(862)
(14,451,000)	プット	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 62.5	9/4/2020	339,627	(14,682)
(22,131,000)	コール	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 7.25	6/5/2020	100,196	(35,984)
(29,193,000)	プット	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 6.9	3/7/2020	24,543	(126,823)
(2,685,000)	コール	OTC AUD/JPY	Citibank	AUD 73	3/3/2020	6,619	(21)
(4,027,000)	コール	OTC AUD/JPY	Citibank	AUD 73	3/3/2020	9,927	(31)
(13,939,000)	プット	OTC USD/BRL	Citibank	USD 3.98	6/3/2020	78,058	-
(10,123,000)	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 19	8/4/2020	34,780	(18,670)
(14,635,000)	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17	8/4/2020	25,461	(51,756)
(14,872,000)	プット	OTC USD/RUB	Citibank	USD 63.5	24/4/2020	22,620	(42,594)
(19,014,000)	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.1067	29/4/2020	(51,563)	(286,629)
(9,756,000)	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 104	1/5/2020	(2,535)	(37,786)
(10,228,000)	プット	OTC CAD/MXN	Citibank	CAD 15.0413	19/5/2020	(46,640)	(206,978)
(8,580,000)	プット	OTC USD/BRL	Credit Suisse	USD 4	9/4/2020	88,034	(254)
(6,041,000)	プット	OTC USD/NOK	Deutsche Bank	USD 9.35	3/3/2020	19,148	(4,086)
(5,251,000)	コール	OTC USD/KRW	Deutsche Bank	USD 1,200	4/3/2020	(24,254)	(41,718)
(5,593,000)	プット	OTC USD/NOK	Deutsche Bank	USD 9.35	6/3/2020	18,819	(10,119)
(6,041,000)	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 112	24/3/2020	29,524	(2,596)
(5,251,000)	コール	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 4.35	2/4/2020	(158,294)	(203,390)
(15,662,000)	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 62.5	2/4/2020	21,707	(11,700)
(1,114,000)	コール	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 14.75	8/4/2020	(36,983)	(71,458)
(2,656,000)	コール	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 14.75	8/4/2020	(111,760)	(170,370)
(3,356,000)	コール	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 15.5	8/4/2020	(50,813)	(93,481)
(8,801,000)	コール	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 14.75	8/4/2020	82,990	-
(3,186,000)	コール	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 64	10/4/2020	(128,673)	(175,383)
(31,864,000)	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 61	10/4/2020	39,747	(9,515)
(22,131,000)	プット	OTC CAD/JPY	Deutsche Bank	CAD 80	13/4/2020	(142,679)	(185,442)
(10,623,000)	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 64	24/4/2020	20,072	(1,036)
(21,460,000)	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 102	16/3/2020	154,040	(4,663)

売建オプション 2020年2月29日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(3,689,000)	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 102	11/3/2020	14,083	(271)
(44,262,000)	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 99	11/3/2020	169,036	(54)
(223,292,000)	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 99	11/3/2020	804,005	(270)
(44,261,500)	プット	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.77	12/3/2020	63,439	(208)
(6,712,000)	コール	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 111	17/3/2020	13,276	(5,081)
(20,136,000)	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 107.5	17/3/2020	(74,913)	(106,426)
(4,475,000)	コール	OTC USD/MXN	HSBC Bank Plc	USD 19.3	25/3/2020	(95,125)	(127,815)
(16,780,000)	プット	OTC USD/MXN	HSBC Bank Plc	USD 18.93	25/3/2020	82,074	(15,981)
(7,150,000)	プット	OTC USD/ZAR	HSBC Bank Plc	USD 14.5	9/4/2020	96,072	(9,033)
(7,746,000)	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 7.1	6/5/2020	12,933	(29,407)
(11,065,000)	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 7.1	6/5/2020	28,530	(42,007)
(7,662,000)	プット	OTC CAD/MXN	HSBC Bank Plc	CAD 14.2893	19/5/2020	7,715	(28,786)
(11,187,000)	コール	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.66	3/3/2020	30,312	(3,255)
(8,949,000)	コール	OTC USD/CHF	JP Morgan	USD 0.9775	4/3/2020	21,560	(4,303)
(20,542,000)	コール	OTC EUR/GBP	JP Morgan	EUR 0.88	11/5/2020	(66,497)	(96,689)
(39,551,000)	コール	OTC EUR/GBP	JP Morgan	EUR 0.86	11/5/2020	(243,259)	(472,192)
(15,930,000)	プット	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.9	3/7/2020	115,874	(69,204)
(15,141,400)	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 18.5	5/3/2020	25,891	(1)
(131,799,000)	コール	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1.1525	17/3/2020	754,737	(9,979)
(8,580,000)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4	9/4/2020	48,429	(254)
(3,319,000)	プット	OTC CAD/JPY	Morgan Stanley	CAD 82	13/4/2020	(27,717)	(60,194)
(22,131,000)	プット	OTC CAD/JPY	Morgan Stanley	CAD 80	15/4/2020	(152,248)	(190,645)
(16,440,000)	コール	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 20.75	15/4/2020	405,365	(86,191)
(20,542,000)	コール	OTC EUR/GBP	Morgan Stanley	EUR 0.875	14/5/2020	(101,473)	(126,987)
(8,437,000)	コール	OTC USD/CNH	Societe Generale	USD 6.98	12/3/2020	4,456	(37,197)
(93,000)	プット	Starbucks Corp	Citibank	USD 82.5	20/3/2020	(605,537)	(653,897)
(3,150)	コール	Altice Europe NV	Exchange Traded	EUR 9	19/6/2020	15,661	(13,820)
(1,287)	コール	Bank of America Corp	Exchange Traded	USD 38	19/6/2020	90,905	(8,365)
(930)	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 99.375	13/12/2021	(117,766)	(523,125)
(1,240)	プット	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF	Exchange Traded	USD 102.5	20/3/2020	(156,662)	(181,040)
(285)	コール	JPMorgan Chase & Co	Exchange Traded	USD 150	19/6/2020	50,767	(11,685)
(182)	プット	Las Vegas Sands Corp	Exchange Traded	USD 62.5	20/3/2020	(99,599)	(125,125)
(1,470)	コール	Lowe's Cos Inc	Exchange Traded	USD 135	17/4/2020	155,522	(32,340)
(47)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,125	20/3/2020	(1,023,047)	(1,237,980)
(47)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,100	20/3/2020	(965,707)	(1,154,085)
(47)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,975	20/3/2020	(650,995)	(784,430)
(49)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,300	20/3/2020	(1,967,474)	(2,078,825)
(49)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,275	20/3/2020	(1,880,558)	(1,971,760)
(69)	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,375	20/3/2020	42,349	(3,450)
(236)	プット	Simon Property Group Inc	Exchange Traded	USD 120	20/3/2020	(88,193)	(94,990)
(455)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 290	20/3/2020	(334,951)	(612,885)
(247)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 290	17/4/2020	(316,694)	(399,893)

売建オプション 2020年2月29日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(2,348)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 333	17/4/2020	332,904	(69,266)
(2,008)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 295	15/5/2020	(2,616,536)	(3,956,764)
(902)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 250	19/6/2020	(375,243)	(663,421)
(304)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 275	30/6/2020	(299,156)	(436,088)
(2,803)	コール	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Exchange Traded	USD 55	17/4/2020	(34,206)	(490,525)
(109)	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 131	6/3/2020	(336,587)	(384,055)
(109)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 130	6/3/2020	33,842	-
(109)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 130.75	6/3/2020	32,609	(1,233)
(109)	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 131.75	6/3/2020	(270,165)	(304,008)
(72)	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 131.75	13/3/2020	(175,646)	(203,625)
(72)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 130.75	13/3/2020	26,292	(1,688)
(164)	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 133	27/3/2020	(256,499)	(287,000)
(4,110)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 126.5	27/3/2020	568,023	-
(174)	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 134	24/4/2020	(162,030)	(270,516)
(1,206)	プット	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 108	27/3/2020	148,919	(37,685)
(1,440)	コール	Verizon Communications Inc	Exchange Traded	USD 65	19/6/2020	147,308	(19,440)
(227)	プット	Wynn Resorts Ltd	Exchange Traded	USD 110	20/3/2020	(148,553)	(187,275)
(223)	コール	Xilinx Inc	Exchange Traded	USD 105	20/3/2020	1,628	(1,895)
合計						(9,040,287)	(21,639,197)

シンセティック・キャップ・オプション 2020年2月29日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
790,590,000	プット	USD - 2 Year Constant Maturity Swap	Citibank	USD 0.50	13/3/2020	(304,377)	-
591,000,000	プット	USD - 10 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.40	31/3/2020	(481,925)	11,560
1,079,632,000	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.21	29/5/2020	(759,629)	913,800
(1,079,632,000)	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.71	29/5/2020	464,015	(21,819)
合計						(1,081,916)	903,541

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

差金決済取引 2020年2月29日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益 / (損) (米ドル)
	ブラジル		
140,724	Oi SA	Merrill Lynch	(11,258)
			<u>(11,258)</u>
	カナダ		
10,431	Bausch Health Cos Inc	Merrill Lynch	(64,672)
			<u>(64,672)</u>
	フランス		
7,294	BNP Paribas SA	Merrill Lynch	(87,279)
16,968	SMCP SA	Merrill Lynch	(31,451)
			<u>(118,730)</u>
	ドイツ		
205,508	Tele Columbus AG	Merrill Lynch	(164,224)
			<u>(164,224)</u>
	イタリア		
2,397,642	Telecom Italia SpA/Milano	Merrill Lynch	(15,778)
20,988	UniCredit SpA	Merrill Lynch	(46,241)
			<u>(62,019)</u>
	日本		
9,307	SoftBank Group Corp	Merrill Lynch	(43,981)
			<u>(43,981)</u>
	ルクセンブルグ		
14,906	Intelsat SA	Merrill Lynch	1,789
			<u>1,789</u>
	オランダ		
8,531	ABN AMRO Bank NV	Merrill Lynch	(25,029)
145,498	ALTICE EUROPE NV	Merrill Lynch	(177,111)
			<u>(202,140)</u>
	スペイン		
50,393	CaixaBank SA	Merrill Lynch	(28,022)
40,186	Telefonica SA	Merrill Lynch	(45,353)
			<u>(73,375)</u>
	英国		
267,824	Arrow Global Group Plc	Merrill Lynch	(192,291)
122,096	Barclays Plc	Merrill Lynch	(47,376)
			<u>(239,667)</u>
合計			<u>(978,277)</u>

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建スワップション 2020年2月29日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 2,050,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.33.V2の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	18/3/2020	16,479	25,612
USD 35,544,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/7/2020より四半期毎に受け取り、2.3%の固定金利を1/10/2020より半年毎に支払う。	Bank of America	30/3/2020	(67,889)	-
USD 101,397,100	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/7/2020より四半期毎に受け取り、1.88%の固定金利を14/10/2020より半年毎に支払う。	Bank of America	8/4/2020	(839,816)	1,388
USD 110,095,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.25%の固定金利を12/2/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/11/2020より四半期毎に支払う。	Bank of America	10/8/2020	480,418	1,030,893
USD 57,865,931	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.08%の固定金利を17/2/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2020より四半期毎に支払う。	Bank of America	13/8/2020	579,955	1,100,535
USD 57,865,931	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2020より四半期毎に受け取り、2.08%の固定金利を17/2/2021より半年毎に支払う。	Bank of America	13/8/2020	(485,060)	12,939
USD 22,650,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/12/2020より四半期毎に受け取り、1.235%の固定金利を1/3/2021より半年毎に支払う。	Bank of America	27/8/2020	(121,617)	314,962
EUR 5,740,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	18/3/2020	174,403	194,678
EUR 15,700,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	18/3/2020	72,780	100,060
EUR 15,700,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	18/3/2020	59,140	100,060
EUR 31,400,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	18/3/2020	41,228	58,462

買建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR 5,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは ITRAXX.XO.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	18/3/2020	134,733	144,289
EUR 51,990,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは ITRAXX.EUR.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Barclays	18/3/2020	326,722	391,221
EUR 26,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは ITRAXX.EUR.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Barclays	18/3/2020	41,499	61,132
USD 156,236,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/7/2020より四半期毎に受け取り、2.3%の固定金利を1/10/2020より半年毎に支払う。	Barclays	30/3/2020	(85,327)	2
USD 60,922,500	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.5%の固定金利を3/12/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を3/9/2020より四半期毎に支払う。	Barclays	1/6/2020	571,382	754,419
JPY 1,354,500,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	(341,507)	2,951
JPY 1,354,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	875,524	1,219,982
USD 165,050,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.2%の固定金利を25/3/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/12/2020より四半期毎に支払う。	Barclays	23/9/2020	870,167	1,390,074
USD 19,910,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/9/2021より四半期毎に受け取り、3.8%の固定金利を9/12/2021より半年毎に支払う。	Barclays	7/6/2021	(758,422)	18,302
USD 16,665,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2021より四半期毎に受け取り、1.65%の固定金利を17/2/2022より半年毎に支払う。	Barclays	13/8/2021	(398,332)	168,278
USD 16,665,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.65%の固定金利を17/2/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	13/8/2021	377,888	944,498

買建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 16,020,250	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/6/2024より四半期毎に受け取り、2.9775%の固定金利を11/9/2024より半年毎に支払う。	Barclays	7/3/2024	(636,449)	100,082
USD 16,020,250	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.9775%の固定金利を11/9/2024より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/6/2024より四半期毎に支払う。	Barclays	7/3/2024	1,837,585	2,574,116
USD 16,020,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.95%の固定金利を14/9/2024より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/6/2024より四半期毎に支払う。	Barclays	12/3/2024	1,813,060	2,535,161
USD 16,020,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/6/2024より四半期毎に受け取り、2.95%の固定金利を14/9/2024より半年毎に支払う。	Barclays	12/3/2024	(618,553)	103,549
EUR 5,300,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	BNP Paribas	18/3/2020	52,172	72,892
EUR 57,480,000	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1%の固定金利を受け取り、ITRAXX.EUR.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に支払う。	BNP Paribas	18/3/2020	376,412	432,533
USD 106,632,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/7/2020より四半期毎に受け取り、2.3%の固定金利を1/10/2020より半年毎に支払う。	Citibank	30/3/2020	(218,594)	1
USD 16,745,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/10/2020より四半期毎に受け取り、2.35%の固定金利を15/1/2021より半年毎に支払う。	Citibank	13/7/2020	(62,002)	683
USD 7,510,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を18/11/2021より四半期毎に受け取り、1.46%の固定金利を18/2/2022より半年毎に支払う。	Citibank	16/8/2021	(150,453)	118,312
USD 7,510,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.46%の固定金利を18/2/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を18/11/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	16/8/2021	64,436	333,200
USD 10,460,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.492%の固定金利を27/8/2025より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を27/5/2025より四半期毎に支払う。	Citibank	25/2/2025	59,844	609,255

買建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 10,460,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を27/5/2025より四半期毎に受け取り、1.492%の固定金利を27/8/2025より半年毎に支払う。	Citibank	25/2/2025	(89,605)	459,807
USD 10,193,500	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.05%の固定金利を29/12/2028より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/9/2028より四半期毎に支払う。	Citibank	27/6/2028	1,033,436	1,609,427
EUR 7,700,000	ファンドは、コール・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.X0.31.V2の変動金利を20/6/2019より四半期毎に支払う。	Citigroup	18/3/2020	(37,429)	975
EUR 8,400,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.X0.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Credit Suisse	18/3/2020	92,770	115,527
USD 4,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.33.V2の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	18/3/2020	31,475	52,473
USD 17,465,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を5/8/2022より四半期毎に受け取り、3.25%の固定金利を5/11/2022より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	(885,150)	39,759
USD 2,500,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.33.V2の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	JP Morgan	18/3/2020	67,987	77,887
USD 111,407,434	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を13/11/2020より四半期毎に受け取り、1.8%の固定金利を13/2/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	11/8/2020	(855,188)	102,297
JPY 592,100,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.78%の固定金利を20/10/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を20/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/4/2021	562,930	747,996
JPY 592,100,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を20/10/2021より半年毎に受け取り、0.78%の固定金利を20/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/4/2021	(177,769)	7,374
USD 32,780,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/11/2022より四半期毎に受け取り、2.25%の固定金利を4/2/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	2/8/2022	(663,884)	221,176

買建スワップシヨ 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 92,660,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/2/2025より四半期毎に受け取り、1.772%の固定金利を7/5/2025より半年毎に支払う。	JP Morgan	5/11/2024	(251,721)	249,569
USD 92,660,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.772%の固定金利を7/5/2025より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/2/2025より四半期毎に支払う。	JP Morgan	5/11/2024	333,608	834,898
USD 14,419,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/8/2028より四半期毎に受け取り、3.1825%の固定金利を4/11/2028より半年毎に支払う。	JP Morgan	2/5/2028	(583,532)	205,909
USD 14,419,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.1825%の固定金利を4/11/2028より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/8/2028より四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/5/2028	1,635,838	2,425,278
USD 2,255,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/7/2038より四半期毎に受け取り、2.985%の固定金利を29/10/2038より半年毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	220,286	326,271
USD 2,255,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.985%の固定金利を29/10/2038より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/7/2038より四半期毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	(47,161)	58,824
USD 2,777,500	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.86%の固定金利を24/8/2039より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2039より四半期毎に支払う。	JP Morgan	22/2/2039	270,498	407,915
USD 2,777,500	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2039より四半期毎に受け取り、2.86%の固定金利を24/8/2039より半年毎に支払う。	JP Morgan	22/2/2039	(49,256)	88,161
USD 32,040,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/9/2024より四半期毎に受け取り、2.5%の固定金利を17/12/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	13/6/2024	(1,074,905)	365,560
USD 4,940,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/4/2029より四半期毎に受け取り、3.0366%の固定金利を16/7/2029より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	11/1/2029	(197,318)	83,892
USD 4,940,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.0366%の固定金利を16/7/2029より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/4/2029より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	11/1/2029	490,957	772,167

買建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 20,510,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/8/2022より四半期毎に受け取り、2.85%の固定金利を11/11/2022より半年毎に支払う。	Nomura	9/5/2022	(1,069,911)	120,975
USD 8,940,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2029より四半期毎に受け取り、3.04%の固定金利を12/7/2029より半年毎に支払う。	Nomura	10/1/2029	(357,090)	151,373
USD 8,940,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.04%の固定金利を12/7/2029より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2029より四半期毎に支払う。	Nomura	10/1/2029	890,717	1,399,179
USD 360,985,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.0925%の固定金利を15/11/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/8/2020より四半期毎に支払う。	UBS	13/5/2020	2,979,126	3,863,539
EUR 12,595,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を20/7/2028より半年毎に受け取り、3%の固定金利を20/1/2029より毎年支払う。	UBS	18/1/2028	(735,962)	99,405
合計				5,575,553	29,802,134

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建スワップション 2020年2月29日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (2,050,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、CDX.NA.HY.33.V2の変動金利を20/12/2019より四半期毎に支払う。	Bank of America	18/3/2020	(4,275)	(7,117)
USD (479,032,782)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.665%の固定金利を14/10/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/7/2020より四半期毎に支払う。	Bank of America	8/4/2020	540,611	(4,623)
USD (91,480,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を21/7/2020より四半期毎に受け取り、2.944%の固定金利を21/10/2020より半年毎に支払う。	Bank of America	17/4/2020	(3,031,556)	(3,667,342)
USD (220,185,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/11/2020より四半期毎に受け取り、0.75%の固定金利を12/2/2021より半年毎に支払う。	Bank of America	10/8/2020	(351,329)	(805,461)
USD (289,329,655)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.88%の固定金利を17/2/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2020より四半期毎に支払う。	Bank of America	13/8/2020	541,208	(12,146)
USD (289,329,655)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2020より四半期毎に受け取り、0.88%の固定金利を17/2/2021より半年毎に支払う。	Bank of America	13/8/2020	(725,761)	(1,357,908)
USD (784,851,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.55%の固定金利を7/4/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/1/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	5/10/2020	3,968,450	(4,858)
USD (627,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.75%の固定金利を15/4/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/1/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	13/10/2020	2,269,373	(3,756)
USD (10,480,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/2/2021より四半期毎に受け取り、1.625%の固定金利を4/5/2021より半年毎に支払う。	Bank of America	2/11/2020	(290,363)	(545,813)
USD (10,480,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.625%の固定金利を4/5/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/2/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	2/11/2020	215,834	(39,616)
USD (15,780,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2022より四半期毎に受け取り、1.65%の固定金利を12/7/2022より半年毎に支払う。	Bank of America	10/1/2022	(545,982)	(914,050)

売建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (15,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.15%の固定金利を12/7/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2022より四半期毎に支払う。	Bank of America	10/1/2022	288,074	(79,994)
USD (12,200,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.85%の固定金利を24/8/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2022より四半期毎に支払う。	Bank of America	22/2/2022	88,715	(126,005)
USD (12,200,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.85%の固定金利を24/8/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2022より四半期毎に支払う。	Bank of America	22/2/2022	82,615	(126,005)
USD (3,450,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/3/2027より四半期毎に受け取り、1.91%の固定金利を1/6/2027より半年毎に支払う。	Bank of America	27/11/2026	(300,103)	(749,466)
USD (3,450,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.91%の固定金利を1/6/2027より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/3/2027より四半期毎に支払う。	Bank of America	27/11/2026	188,316	(261,047)
EUR (51,990,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1%の固定金利を受け取り、ITRAXX.EUR.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に支払う。	Barclays	18/3/2020	(239,401)	(273,801)
EUR (5,740,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に支払う。	Barclays	18/3/2020	(117,173)	(127,406)
USD (121,843,125)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を3/9/2020より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を3/12/2020より半年毎に支払う。	Barclays	1/6/2020	(404,034)	(570,925)
USD (21,340,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.203%の固定金利を15/12/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/9/2020より四半期毎に支払う。	Barclays	11/6/2020	464,822	(656)
USD (21,340,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/9/2020より四半期毎に受け取り、2.203%の固定金利を15/12/2020より半年毎に支払う。	Barclays	11/6/2020	(1,775,710)	(2,241,189)
EUR (29,955,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0%の固定金利を29/7/2021より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を29/1/2021より半年毎に支払う。	Barclays	27/7/2020	64,983	(19,604)

売建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (10,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2%の固定金利を5/2/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を5/11/2020より四半期毎に支払う。	Barclays	3/8/2020	146,484	(2,516)
USD (330,110,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/12/2020より四半期毎に受け取り、0.7%の固定金利を25/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	23/9/2020	(782,192)	(1,145,313)
USD (100,980,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2%の固定金利を1/6/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/3/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	27/11/2020	125,607	(11,221)
USD (24,030,250)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/6/2021より四半期毎に受け取り、2.7875%の固定金利を10/9/2021より半年毎に支払う。	Barclays	8/3/2021	(3,072,311)	(3,788,713)
USD (24,030,250)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.7875%の固定金利を10/9/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/6/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	8/3/2021	702,837	(13,565)
EUR (155,850,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.1%の固定金利を31/3/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を30/9/2021より半年毎に支払う。	Barclays	29/3/2021	521,742	(21,008)
EUR (14,100,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2%の固定金利を6/5/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を6/11/2021より半年毎に支払う。	Barclays	4/5/2021	347,556	(3,999)
EUR (79,776,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.11%の固定金利を19/5/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を19/11/2021より半年毎に支払う。	Barclays	17/5/2021	249,522	(14,629)
USD (259,565,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.15%の固定金利を1/12/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/9/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	27/5/2021	698,323	(29,756)
USD (42,170,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.87%の固定金利を9/12/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/9/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	7/6/2021	811,560	(14,582)
EUR (79,370,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.05%の固定金利を14/6/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を14/12/2021より半年毎に支払う。	Barclays	10/6/2021	177,963	(21,589)

売建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (40,830,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.05%の固定金利を7/7/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を7/1/2022より半年毎に支払う。	Barclays	2/7/2021	67,253	(18,974)
EUR (95,440,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.15%の固定金利を11/8/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を11/2/2022より半年毎に支払う。	Barclays	9/8/2021	53,045	(79,376)
EUR (53,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.15%の固定金利を11/8/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を11/2/2022より半年毎に支払う。	Barclays	9/8/2021	28,124	(44,753)
USD (15,750,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/4/2022より四半期毎に受け取り、1.6%の固定金利を10/7/2022より半年毎に支払う。	Barclays	6/1/2022	(498,481)	(859,746)
USD (15,750,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.1%の固定金利を10/7/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/4/2022より四半期毎に支払う。	Barclays	6/1/2022	275,152	(86,114)
USD (30,810,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/6/2022より四半期毎に受け取り、1.246%の固定金利を2/9/2022より半年毎に支払う。	Barclays	28/2/2022	(157,933)	(705,581)
USD (30,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.246%の固定金利を2/9/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/6/2022より四半期毎に支払う。	Barclays	28/2/2022	137,650	(409,998)
EUR (10,450,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を15/3/2023より半年毎に受け取り、-0.035%の固定金利を15/9/2023より毎年支払う。	Barclays	13/9/2022	(55,155)	(217,662)
EUR (10,450,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.035%の固定金利を15/9/2023より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を15/3/2023より半年毎に支払う。	Barclays	13/9/2022	57,831	(104,677)
USD (12,705,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/6/2029より四半期毎に受け取り、3.05%の固定金利を14/9/2029より半年毎に支払う。	Barclays	12/3/2029	(1,322,360)	(1,996,360)
USD (12,705,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.05%の固定金利を14/9/2029より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/6/2029より四半期毎に支払う。	Barclays	12/3/2029	456,549	(217,451)

売建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (26,721,721)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.715%の固定金利を9/9/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/6/2020より四半期毎に支払う。	Citibank	5/3/2020	86,054	-
USD (133,608,606)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.565%の固定金利を8/10/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/7/2020より四半期毎に支払う。	Citibank	6/4/2020	118,526	(3,256)
USD (16,020,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.3%の固定金利を17/12/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/9/2020より四半期毎に支払う。	Citibank	15/6/2020	243,478	(348)
USD (8,370,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/10/2020より四半期毎に受け取り、1.95%の固定金利を15/1/2021より半年毎に支払う。	Citibank	13/7/2020	87,706	(2,089)
USD (33,510,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.42%の固定金利を19/2/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/11/2020より四半期毎に支払う。	Citibank	17/8/2020	664,996	(206,264)
USD (33,510,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/11/2020より四半期毎に受け取り、1.42%の固定金利を19/2/2021より半年毎に支払う。	Citibank	17/8/2020	(350,552)	(1,221,812)
USD (49,530,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より四半期毎に受け取り、1.53%の固定金利を16/6/2021より半年毎に支払う。	Citibank	14/12/2020	(462,775)	(700,519)
USD (49,530,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.53%の固定金利を16/6/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	14/12/2020	216,766	(20,978)
EUR (121,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.1%の固定金利を14/4/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を14/10/2021より半年毎に支払う。	Citibank	12/4/2021	388,547	(18,169)
USD (193,485,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.35%の固定金利を19/11/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/8/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	17/5/2021	367,507	(16,077)
EUR (7,700,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Citigroup	18/3/2020	36,221	(563)

売建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (57,480,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1%の固定金利を受け取り、ITRAXX.EUR.32.V1の変動金利を20/12/2019より四半期毎に支払う。	Credit Suisse	18/3/2020	(333,082)	(364,260)
USD (93,400,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/7/2020より四半期毎に受け取り、2.8775%の固定金利を16/10/2020より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/4/2020	(2,953,881)	(3,629,863)
USD (22,365,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.355%の固定金利を31/8/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を31/5/2022より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	24/2/2022	199,716	(603,187)
USD (87,445,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を31/5/2022より四半期毎に受け取り、1.375%の固定金利を31/8/2022より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	24/2/2022	(619,099)	(3,758,375)
USD (87,445,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.375%の固定金利を31/8/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を31/5/2022より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	24/2/2022	866,843	(2,272,432)
USD (22,365,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を31/5/2022より四半期毎に受け取り、1.355%の固定金利を31/8/2022より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	24/2/2022	(138,309)	(941,212)
USD (69,325,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.39%の固定金利を1/9/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/6/2022より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	25/2/2022	670,509	(1,755,866)
USD (44,185,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/6/2022より四半期毎に受け取り、1.33%の固定金利を1/9/2022より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	25/2/2022	(255,479)	(1,809,686)
USD (44,185,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.33%の固定金利を1/9/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/6/2022より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	25/2/2022	304,365	(1,249,843)
USD (69,325,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/6/2022より四半期毎に受け取り、1.39%の固定金利を1/9/2022より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	25/2/2022	(598,592)	(3,024,967)
USD (4,200,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、CDX.NA.HY.33.V2の変動金利を20/12/2019より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	18/3/2020	(10,839)	(14,581)

売建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (250,597,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/7/2020より四半期毎に受け取り、1.9%の固定金利を29/10/2020より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/4/2020	(4,229,148)	(4,905,760)
USD (32,240,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.3%の固定金利を29/1/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/10/2020より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	27/7/2020	392,681	(2,259)
USD (49,530,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/3/2021より四半期毎に受け取り、1.535%の固定金利を15/6/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	11/12/2020	(468,203)	(704,709)
USD (49,530,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.535%の固定金利を15/6/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/3/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	11/12/2020	216,080	(20,426)
EUR (121,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.16%の固定金利を14/4/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を14/10/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	12/4/2021	396,683	(14,055)
USD (43,665,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.25%の固定金利を5/11/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を5/8/2022より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	878,305	(35,013)
USD (92,660,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/2/2021より四半期毎に受け取り、1.582%の固定金利を9/5/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	5/11/2020	(464,813)	(683,954)
USD (92,660,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.582%の固定金利を9/5/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/2/2021より四半期毎に支払う。	JP Morgan	5/11/2020	203,013	(16,128)
EUR (23,400,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.15%の固定金利を21/4/2022より半年毎に受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を21/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	19/4/2021	496,376	(4,971)
USD (111,407,434)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2%の固定金利を15/8/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/5/2022より四半期毎に支払う。	JP Morgan	11/2/2022	1,364,820	(790,914)
USD (32,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.75%の固定金利を4/2/2023より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/11/2022より四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/8/2022	340,017	(109,069)

売建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (32,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.25%の固定金利を4/2/2023より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/11/2022より四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/8/2022	149,908	(64,801)
USD (164,162,648)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を27/6/2020より四半期毎に受け取り、1.09%の固定金利を27/9/2020より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	25/3/2020	(1,031,223)	(1,602,347)
USD (726,295,102)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を27/6/2020より四半期毎に受け取り、1.06%の固定金利を27/9/2020より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	25/3/2020	(1,963,583)	(2,643,489)
EUR (121,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.15%の固定金利を21/4/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を21/10/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	19/4/2021	422,920	(15,510)
EUR (51,990,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.08%の固定金利を2/6/2022より毎年受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利2/12/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	31/5/2021	139,743	(11,775)
USD (321,250,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.4%の固定金利を3/12/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を3/9/2021より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	1/6/2021	554,394	(27,068)
USD (15,830,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/5/2022より四半期毎に受け取り、1.45%の固定金利を1/8/2022より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	28/1/2022	(359,395)	(729,421)
USD (15,830,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.95%の固定金利を1/8/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/5/2022より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	28/1/2022	247,182	(122,844)
USD (32,040,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.5%の固定金利を17/12/2024より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/9/2024より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	13/6/2024	393,685	(142,551)
USD (32,040,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3%の固定金利を17/12/2024より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/9/2024より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	13/6/2024	663,522	(216,324)
USD (16,785,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.25%の固定金利を22/2/2025より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を22/11/2024より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	20/8/2024	217,163	(280,457)

売建スワップション 2020年2月29日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (377,330,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.76%の固定金利を12/12/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/9/2020より四半期毎に支払う。	Nomura	10/6/2020	1,069,455	(10,652)
USD (377,330,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/9/2020より四半期毎に受け取り、1.76%の固定金利を12/12/2020より半年毎に支払う。	Nomura	10/6/2020	(1,932,971)	(3,013,078)
USD (23,050,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.35%の固定金利を14/1/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/10/2020より四半期毎に支払う。	Nomura	10/7/2020	232,172	(864)
USD (44,725,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.75%の固定金利を11/11/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/8/2022より四半期毎に支払う。	Nomura	9/5/2022	1,171,365	(124,097)
USD (10,480,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.635%の固定金利を4/5/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/2/2021より四半期毎に支払う。	UBS	2/11/2020	214,874	(38,218)
USD (10,480,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/2/2021より四半期毎に受け取り、1.635%の固定金利を4/5/2021より半年毎に支払う。	UBS	2/11/2020	(301,296)	(554,388)
合計				<u>(2,561,568)</u>	<u>(60,245,860)</u>

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2020年2月29日現在(未監査)

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
コマーシャル・ペーパー			
英国			
USD	6,000,000 B.A.T International Finance Plc 1/4/2020 (Zero Coupon)	5,989,981	0.31
米国			
USD	12,000,000 Boeing Co/The 18/11/2020 (Zero Coupon)	11,819,447	0.61
USD	10,000,000 Broadcom Inc 4/3/2020 (Zero Coupon)	9,995,623	0.52
USD	10,000,000 Broadcom Inc 17/3/2020 (Zero Coupon)	9,986,658	0.51
USD	8,000,000 Ford Motor Credit Co LLC 25/9/2020 (Zero Coupon)	7,889,624	0.41
USD	4,600,000 General Electric Co 1/4/2020 (Zero Coupon)	4,592,319	0.24
USD	9,000,000 Nissan Motor Acceptance Corp 12/6/2020 (Zero Coupon)	8,949,385	0.46
USD	10,000,000 Southern California Edison Co 9/3/2020 (Zero Coupon)	9,994,454	0.51
		63,227,510	3.26
コマーシャル・ペーパー合計			
		69,217,491	3.57
債券			
アルゼンチン			
USD	236,250 Aeropuertos Argentina 2000 SA '144A' 6.875% 1/2/2027	222,444	0.01
USD	650,000 Arcor SAIC '144A' 6% 6/7/2023	627,555	0.03
USD	440,000 Pampa Energia SA '144A' 7.375% 21/7/2023	388,781	0.02
USD	540,000 Telecom Argentina SA '144A' 6.5% 15/6/2021	529,200	0.03
USD	400,000 YPF SA '144A' 8.75% 4/4/2024*	365,000	0.02
		2,132,980	0.11
オーストラリア			
AUD	152,369 National Rmbs Trust 2012-2 'Series 2012-2 A1' FRN 20/6/2044	99,577	0.01
EUR	1,100,000 Telstra Corp Ltd 3.5% 21/9/2022*	1,320,315	0.07
AUD	964,471 TORRENS Series 2013-1 Trust 'Series 2013-1 A' FRN 12/4/2044	628,790	0.03
USD	8,450,000 Westpac Banking Corp '144A' 3.15% 16/1/2024	8,985,266	0.46
		11,033,948	0.57
オーストリア			
USD	200,000 BRF GmbH 4.35% 29/9/2026	203,438	0.01
USD	200,000 Suzano Austria GmbH 5.75% 14/7/2026	227,500	0.01
		430,938	0.02
バーレーン			
USD	520,000 CBB International Sukuk Co 7 SPC 6.875% 5/10/2025	605,150	0.03
ベルギー			
EUR	900,000 KBC Group NV 1.125% 25/1/2024	1,019,257	0.05

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
バミューダ諸島			
USD	200,000 Geopark Ltd '144A' 5.5% 17/1/2027	194,400	0.01
ブラジル			
USD	5,000,000 Banco Bradesco SA/Cayman Islands '144A' 2.85% 27/1/2023	4,990,625	0.26
USD	260,000 Banco Bradesco SA/Cayman Islands '144A' 3.2% 27/1/2025	260,487	0.01
USD	230,000 Banco Votorantim SA '144A' 4.5% 24/9/2024	242,470	0.01
USD	510,000 Brazilian Government International Bond 4.625% 13/1/2028	563,938	0.03
USD	640,000 Brazilian Government International Bond 4.875% 22/1/2021	658,500	0.04
USD	270,000 Centrais Eletricas Brasileiras SA '144A' 3.625% 4/2/2025	268,453	0.01
USD	250,000 Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island '144A' 3.25% 24/1/2025	248,675	0.01
		7,233,148	0.37
英領バージン諸島			
USD	520,000 Central American Bottling Corp '144A' 5.75% 31/1/2027	549,981	0.03
USD	330,000 Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd '144A' 5.125% 15/5/2024	361,092	0.02
		911,073	0.05
カナダ			
USD	1,347,619 Air Canada 2013-1 Class B Pass Through Trust '144A' 5.375% 15/5/2021	1,390,753	0.07
EUR	1,480,000 Toronto-Dominion Bank/The 0.375% 25/4/2024	1,639,531	0.08
USD	475,000 TransCanada PipeLines Ltd 3.75% 16/10/2023	503,243	0.03
		3,533,527	0.18
ケイマン諸島			
USD	2,780,000 Baidu Inc 2.875% 6/7/2022*	2,838,630	0.15
USD	1,720,000 OFSI Fund VI Ltd FRN 20/3/2025	1,703,748	0.09
USD	210,000 Vale Overseas Ltd 6.25% 10/8/2026	246,750	0.01
		4,789,128	0.25
チリ			
USD	250,000 Chile Government International Bond 2.25% 30/10/2022*	253,265	0.01
USD	1,040,000 Chile Government International Bond 3.125% 27/3/2025	1,097,460	0.06
USD	360,000 Chile Government International Bond 3.125% 21/1/2026	381,937	0.02
USD	1,080,000 Chile Government International Bond 3.24% 6/2/2028	1,166,569	0.06
USD	2,000,000 Empresa Nacional del Petroleo '144A' 5.25% 10/8/2020	2,034,062	0.10
USD	550,000 Enel Americas SA 4% 25/10/2026	593,192	0.03
USD	790,000 GNL Quintero SA 4.634% 31/7/2029	854,558	0.04
USD	310,000 Inversiones CMPC SA '144A' 3.85% 13/1/2030	319,688	0.02
		6,700,731	0.34

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
コロンビア			
USD	200,000 Bancolombia SA 3% 29/1/2025	200,750	0.01
USD	660,000 Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	710,428	0.04
USD	700,000 Colombia Government International Bond 4% 26/2/2024	744,297	0.04
USD	980,000 Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026	1,081,828	0.05
USD	450,000 Colombia Government International Bond 4.5% 15/3/2029	509,625	0.03
USD	790,000 Colombia Government International Bond 8.125% 21/5/2024	977,749	0.05
USD	540,000 Ecopetrol SA 5.375% 26/6/2026	605,981	0.03
USD	680,000 SURA Asset Management SA '144A' 4.875% 17/4/2024	735,356	0.04
		5,566,014	0.29
クロアチア			
USD	570,000 Croatia Government International Bond 6.625% 14/7/2020	579,619	0.03
デンマーク			
USD	4,060,000 Danske Bank A/S '144A' FRN 20/9/2022	4,107,582	0.21
ドミニカ共和国			
USD	200,000 Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA '144A' 6.75% 30/3/2029	222,943	0.01
USD	290,000 Dominican Republic International Bond 5.5% 27/1/2025	312,067	0.02
USD	270,000 Dominican Republic International Bond 6.875% 29/1/2026	308,644	0.01
		843,654	0.04
エジプト			
EGP	8,230,000 Egypt Government Bond 14.3% 3/9/2022	534,327	0.03
EGP	7,590,000 Egypt Government Bond 16% 11/6/2022	501,755	0.02
EUR	100,000 Egypt Government International Bond '144A' 4.75% 11/4/2025	113,654	0.00
USD	310,000 Egypt Government International Bond '144A' 5.577% 21/2/2023	318,913	0.02
USD	550,000 Egypt Government International Bond 5.75% 29/4/2020	553,953	0.03
USD	360,000 Egypt Government International Bond '144A' 6.125% 31/1/2022	374,231	0.02
USD	950,000 Egypt Government International Bond 6.125% 31/1/2022	987,555	0.05
EUR	330,000 Egypt Government International Bond '144A' 6.375% 11/4/2031	377,772	0.02
EGP	11,500,000 Egypt Treasury Bills 26/5/2020 (Zero Coupon)	713,835	0.04
		4,475,995	0.23
フランス			
EUR	600,000 Air Liquide Finance SA 0.375% 18/4/2022	665,902	0.03
EUR	400,000 APRR SA 20/1/2023 (Zero Coupon)	441,934	0.02
EUR	600,000 Autoroutes du Sud de la France SA 2.95% 17/1/2024	732,545	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フランス(続き)			
EUR	800,000 Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.125% 5/2/2024	878,924	0.04
EUR	700,000 Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 15/6/2023	786,529	0.04
EUR	100,000 Banque Federative du Credit Mutuel SA 2.625% 18/3/2024	121,070	0.01
EUR	1,375,000 BNP Paribas SA 1.125% 15/1/2023	1,560,562	0.08
EUR	500,000 BPCE SA 0.25% 15/1/2026	549,215	0.03
EUR	1,700,000 Dassault Systemes SE 16/9/2022 (Zero Coupon)	1,873,224	0.10
EUR	900,000 Engie SA 0.375% 28/2/2023	1,003,363	0.05
EUR	900,000 HSBC France SA 0.25% 17/5/2024	993,242	0.05
EUR	1,600,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 28/2/2021 (Zero Coupon)	1,760,788	0.09
EUR	700,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 11/2/2024 (Zero Coupon)	768,586	0.04
EUR	1,100,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 11/2/2026 (Zero Coupon)	1,202,386	0.06
EUR	700,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.125% 28/2/2023	774,041	0.04
EUR	80,000 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.375% 26/5/2022	88,787	0.00
EUR	800,000 Orange SA 0.5% 15/1/2022	887,751	0.05
EUR	2,000,000 Orange SA 0.75% 11/9/2023	2,257,003	0.12
EUR	2,400,000 Pernod Ricard SA 24/10/2023 (Zero Coupon)	2,635,140	0.14
EUR	300,000 RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.625% 8/10/2024	354,742	0.02
EUR	600,000 Schneider Electric SE 0.25% 9/9/2024	668,434	0.03
EUR	1,800,000 Societe Generale SA 27/5/2022 (Zero Coupon)	1,979,721	0.10
EUR	900,000 Thales SA 31/5/2022 (Zero Coupon)	988,267	0.05
EUR	900,000 Thales SA 0.75% 7/6/2023*	1,009,471	0.05
EUR	1,100,000 Total Capital International SA 0.25% 12/7/2023	1,225,074	0.06
EUR	600,000 Total Capital International SA 2.125% 15/3/2023	705,279	0.04
EUR	1,200,000 Veolia Environnement SA 0.672% 30/3/2022*	1,335,947	0.07
		28,247,927	1.45
ドイツ			
EUR	1,105,000 BASF SE 2% 5/12/2022	1,287,028	0.07
USD	3,695,000 Deutsche Bank AG/New York NY 4.25% 4/2/2021	3,765,421	0.19
EUR	1,315,000 E.ON SE 24/10/2022 (Zero Coupon)	1,447,212	0.07
EUR	2,100,000 Merck Financial Services GmbH 0.005% 15/12/2023	2,303,733	0.12
EUR	1,200,000 SAP SE 0.25% 10/3/2022	1,330,297	0.07
EUR	1,100,000 Volkswagen Bank GmbH 1.875% 31/1/2024	1,267,209	0.06
EUR	1,900,000 Volkswagen Leasing GmbH FRN 2/8/2021	2,084,819	0.11
EUR	2,455,000 Volkswagen Leasing GmbH 1% 16/2/2023	2,744,373	0.14
		16,230,092	0.83
ガーンジー島			
USD	2,065,000 Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd 3.125% 10/12/2020	2,085,824	0.11

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
インド			
USD 200,000	Adani Electricity Mumbai Ltd '144A' 3.949% 12/2/2030	204,917	0.01
USD 250,000	Future Retail Ltd '144A' 5.6% 22/1/2025	250,625	0.01
USD 290,000	Muthoot Finance Ltd '144A' 6.125% 31/10/2022	299,942	0.02
		755,484	0.04
インドネシア			
EUR 490,000	Indonesia Government International Bond 0.9% 14/2/2027	540,429	0.03
USD 420,000	Indonesia Government International Bond 3.5% 11/1/2028	444,942	0.02
USD 340,000	Indonesia Government International Bond 3.75% 25/4/2022	352,963	0.02
USD 310,000	Indonesia Government International Bond 4.1% 24/4/2028	344,502	0.02
USD 530,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 8/1/2026	596,498	0.03
USD 200,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 11/2/2029	233,922	0.01
IDR 17,285,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15/5/2028	1,129,443	0.06
		3,642,699	0.19
アイルランド			
EUR 820,000	Abbott Ireland Financing DAC 0.1% 19/11/2024	899,180	0.05
EUR 1,030,000	Abbott Ireland Financing DAC 0.875% 27/9/2023	1,161,196	0.06
USD 1,700,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 2.875% 14/8/2024	1,725,537	0.09
USD 2,160,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.3% 23/1/2023	2,227,309	0.12
USD 4,300,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 26/5/2022	4,437,200	0.23
USD 3,016,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 15/1/2025	3,146,629	0.16
USD 3,000,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.95% 1/2/2022	3,099,325	0.16
USD 1,010,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.25% 1/7/2020	1,018,177	0.05
USD 2,889,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.5% 15/5/2021	2,979,078	0.15
USD 325,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.625% 1/7/2022	343,664	0.02
USD 790,000	AIB Group Plc '144A' FRN 10/4/2025	846,777	0.04
EUR 1,590,000	Eaton Capital Unlimited Co 0.021% 14/5/2021	1,747,803	0.09
EUR 525,000	ESB Finance DAC 3.494% 12/1/2024	655,749	0.03
USD 11,000,000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 2.342% 15/11/2020	11,027,922	0.57
USD 310,000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC '144A' 3.05% 23/1/2025	311,163	0.02
EUR 470,000	River Green Finance 2020 DAC 22/1/2032	517,717	0.03
EUR 245,000	River Green Finance 2020 DAC 22/1/2032	270,011	0.01
EUR 945,000	River Green Finance 2020 DAC 22/1/2032	1,040,020	0.05
USD 1,200,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/9/2023	1,243,369	0.06

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
USD	754,000 Willis Towers Watson Plc 5.75% 15/3/2021	783,574	0.04
		39,481,400	2.03
イスラエル			
USD	515,000 Bank Leumi Le-Israel BM '144A' FRN 29/1/2031	516,391	0.03
日本			
USD	3,441,000 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc (Restricted) 2.95% 1/3/2021	3,488,186	0.18
USD	705,000 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.535% 26/7/2021	725,406	0.04
EUR	1,045,000 Mizuho Financial Group Inc 0.523% 10/6/2024	1,162,077	0.06
USD	5,395,000 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.846% 11/1/2022	5,513,893	0.28
USD	1,480,000 Takeda Pharmaceutical Co Ltd 4.4% 26/11/2023*	1,612,868	0.08
		12,502,430	0.64
ルクセンブルク			
EUR	320,000 Allergan Funding SCS 1.25% 1/6/2024	366,122	0.02
USD	8,459,000 Allergan Funding SCS (Restricted) 3.45% 15/3/2022	8,732,312	0.45
EUR	440,000 Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.632% 4/6/2023	490,350	0.03
EUR	625,000 DH Europe Finance II Sarl 0.2% 18/3/2026	683,929	0.04
EUR	1,500,000 DH Europe Finance Sarl FRN 30/6/2022	1,646,568	0.08
USD	160,000 Gol Finance SA '144A' 7% 31/1/2025	152,950	0.01
USD	230,000 Klabin Finance SA '144A' 4.875% 19/9/2027	242,938	0.01
EUR	2,560,000 Medtronic Global Holdings SCA 2/12/2022 (Zero Coupon)	2,813,919	0.14
EUR	1,175,000 Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 7/3/2023	1,304,484	0.07
USD	430,000 Millicom International Cellular SA '144A' 5.125% 15/1/2028	447,737	0.02
USD	210,000 Minerva Luxembourg SA '144A' 6.5% 20/9/2026	219,253	0.01
USD	200,000 Nexa Resources SA '144A' 5.375% 4/5/2027	211,250	0.01
USD	230,000 Rumo Luxembourg Sarl '144A' 5.875% 18/1/2025	245,561	0.01
EUR	360,000 Simon International Finance SCA 1.375% 18/11/2022	409,496	0.02
USD	200,000 Usiminas International Sarl '144A' 5.875% 18/7/2026	204,250	0.01
		18,171,119	0.93
メキシコ			
USD	150,000 BBVA Bancomer SA/Texas '144A' 6.75% 30/9/2022	163,898	0.01
USD	200,000 Braskem Idesa SAPI '144A' 7.45% 15/11/2029	201,000	0.01
USD	520,000 Grupo Bimbo SAB de CV 4.5% 25/1/2022	547,056	0.03
USD	200,000 Grupo KUO SAB De CV '144A' 5.75% 7/7/2027	205,106	0.01
MXN	12,770,000 Mexico Cetes 2/4/2020 (Zero Coupon)	6,430,205	0.33
USD	550,000 Mexico City Airport Trust '144A' 4.25% 31/10/2026	596,149	0.03
USD	250,000 Mexico Government International Bond 3.6% 30/1/2025	266,484	0.01
USD	380,000 Mexico Government International Bond 4.125% 21/1/2026	416,456	0.02
USD	400,000 Mexico Government International Bond 4.5% 22/4/2029	452,813	0.02
USD	260,000 Operadora de Servicios Mega SA de CV Sofom ER '144A' 8.25% 11/2/2025	266,890	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
メキシコ(続き)			
USD	1,400,000 Petroleos Mexicanos ' 144A ' 5.95% 28/1/2031	1,387,414	0.07
USD	410,000 Petroleos Mexicanos ' 144A ' 6.84% 23/1/2030	433,370	0.02
USD	450,000 Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	493,875	0.03
		11,860,716	0.61
オランダ			
EUR	300,000 Allianz Finance II BV 14/1/2025 (Zero Coupon)	330,760	0.02
EUR	1,400,000 Allianz Finance II BV 0.25% 6/6/2023	1,555,324	0.08
EUR	1,530,000 BMW Finance NV 14/4/2023 (Zero Coupon)	1,677,662	0.09
EUR	150,000 Daimler International Finance BV 0.25% 9/8/2021	165,320	0.01
EUR	450,000 Daimler International Finance BV 0.25% 6/11/2023	494,328	0.03
EUR	1,860,000 Enel Finance International NV 17/6/2024 (Zero Coupon)*	2,032,085	0.10
EUR	600,000 Enexis Holding NV 3.375% 26/1/2022	704,133	0.04
EUR	600,000 ING Bank NV 8/4/2022 (Zero Coupon)	660,002	0.03
EUR	1,300,000 ING Bank NV FRN 8/4/2022	1,433,541	0.07
EUR	1,094,000 ING Bank NV FRN 25/2/2026	1,239,788	0.06
EUR	1,100,000 ING Groep NV 1% 20/9/2023	1,239,738	0.06
EUR	275,000 innogy Finance BV 0.75% 30/11/2022	308,194	0.02
EUR	300,000 Magoi 2019 BV FRN 27/7/2039	329,758	0.02
USD	470,000 MDGH - GMTN BV ' 144A ' 2.5% 7/11/2024	479,106	0.02
USD	3,393,000 NXP BV / NXP Funding LLC ' 144A ' 3.875% 1/9/2022	3,544,118	0.18
USD	1,967,000 NXP BV / NXP Funding LLC ' 144A ' 4.125% 1/6/2021	2,019,425	0.10
USD	1,195,000 NXP BV / NXP Funding LLC ' 144A ' 4.625% 15/6/2022	1,265,171	0.07
USD	3,200,000 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc ' 144A ' 3.875% 18/6/2026	3,437,120	0.18
USD	200,000 Petrobras Global Finance BV 4.375% 20/5/2023	210,625	0.01
USD	1,040,000 Petrobras Global Finance BV 5.299% 27/1/2025	1,141,400	0.06
USD	140,000 Petrobras Global Finance BV 7.375% 17/1/2027	171,444	0.01
EUR	1,905,000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 5/9/2021 (Zero Coupon)	2,099,687	0.11
EUR	1,100,000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 20/2/2023 (Zero Coupon)	1,211,579	0.06
EUR	1,450,000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.375% 6/9/2023	1,618,352	0.08
USD	240,000 VEON Holdings BV ' 144A ' 4% 9/4/2025	250,500	0.01
EUR	1,000,000 Vonovia Finance BV 0.125% 6/4/2023	1,099,258	0.06
		30,718,418	1.58
ナイジェリア			
USD	260,000 Nigeria Government International Bond 6.375% 12/7/2023	277,306	0.01
USD	710,000 Nigeria Government International Bond 7.625% 21/11/2025	779,669	0.04
		1,056,975	0.05
ノルウェー			
EUR	460,000 Telenor ASA 25/9/2023 (Zero Coupon)	506,368	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
パナマ			
USD	640,000 AES Panama SRL '144A' 6% 25/6/2022	655,912	0.03
USD	240,000 Avianca Holdings SA '144A' 9% 10/5/2023	216,600	0.01
USD	200,000 Cable Onda SA '144A' 4.5% 30/1/2030	205,750	0.01
USD	670,000 Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	745,898	0.04
USD	740,000 Panama Government International Bond 4% 22/9/2024	801,859	0.04
		2,626,019	0.13
ペルー			
USD	540,000 Banco Internacional del Peru SAA Interbank '144A' 3.25% 4/10/2026	552,403	0.03
フィリピン			
USD	960,000 Philippine Government International Bond 4.2% 21/1/2024	1,046,550	0.06
USD	670,000 Philippine Government International Bond 5.5% 30/3/2026	805,152	0.04
		1,851,702	0.10
ポーランド			
USD	510,000 Republic of Poland Government International Bond 3% 17/3/2023	532,392	0.03
USD	520,000 Republic of Poland Government International Bond 3.25% 6/4/2026	563,144	0.03
		1,095,536	0.06
カタール			
USD	980,000 Qatar Government International Bond '144A' 4% 14/3/2029	1,112,147	0.06
USD	1,480,000 Qatar Government International Bond 4.5% 23/4/2028	1,715,875	0.09
		2,828,022	0.15
ロシア連邦			
USD	1,400,000 Russian Foreign Bond - Eurobond 4.25% 23/6/2027	1,548,750	0.08
USD	1,000,000 Russian Foreign Bond - Eurobond 4.75% 27/5/2026	1,127,031	0.06
		2,675,781	0.14
サウジアラビア			
USD	865,000 Saudi Arabian Oil Co '144A' 2.875% 16/4/2024	887,274	0.05
USD	240,000 Saudi Arabian Oil Co '144A' 3.5% 16/4/2029	254,962	0.01
USD	1,040,000 Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026	1,095,900	0.06
USD	540,000 Saudi Government International Bond 4% 17/4/2025	585,900	0.03
USD	570,000 Saudi Government International Bond '144A' 4.375% 16/4/2029	650,156	0.03
		3,474,192	0.18
スペイン			
EUR	800,000 Amadeus Capital Markets SAU 1.625% 17/11/2021	900,080	0.04
EUR	500,000 Banco de Sabadell SA FRN 7/11/2025	546,273	0.03
EUR	300,000 Banco de Sabadell SA 0.875% 22/7/2025	332,464	0.02
USD	2,800,000 Banco Santander SA 2.706% 27/6/2024	2,894,094	0.15
		4,672,911	0.24

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スウェーデン			
EUR	1,355,000 Atlas Copco AB 2.5% 28/2/2023	1,609,102	0.08
USD	5,690,000 Skandinaviska Enskilda Banken AB '144A' 2.2% 12/12/2022	5,764,909	0.30
USD	1,500,000 Swedbank AB '144A' 2.8% 14/3/2022	1,532,344	0.08
EUR	1,000,000 Volvo Treasury AB FRN 13/9/2021	1,103,514	0.06
EUR	241,000 Volvo Treasury AB 11/2/2023 (Zero Coupon)	265,166	0.01
		10,275,035	0.53
スイス			
USD	3,430,000 Credit Suisse Group AG '144A' 3.574% 9/1/2023	3,535,427	0.18
EUR	1,460,000 UBS AG FRN 12/2/2026	1,668,601	0.09
USD	2,215,000 UBS Group AG '144A' FRN 15/8/2023	2,267,116	0.12
EUR	715,000 UBS Group AG FRN 29/1/2026	792,549	0.04
		8,263,693	0.43
トルコ			
USD	245,000 Turkey Government International Bond 7.625% 26/4/2029	264,064	0.01
ウクライナ			
USD	250,000 Ukraine Government International Bond 8.994% 1/2/2024*	280,937	0.02
USD	390,000 Ukraine Government International Bond 9.75% 1/11/2028	471,108	0.02
		752,045	0.04
英国			
USD	677,000 Anglo American Capital Plc '144A' 4.125% 15/4/2021	693,204	0.04
USD	1,665,000 Aon Plc 2.8% 15/3/2021	1,683,179	0.09
USD	2,200,000 Barclays Bank Plc 5.14% 14/10/2020	2,245,126	0.12
USD	2,125,000 Barclays Plc FRN 15/2/2023	2,229,728	0.11
USD	6,600,000 Barclays Plc 2.875% 8/6/2020	6,610,831	0.34
EUR	545,000 BAT International Finance Plc 0.875% 13/10/2023	610,537	0.03
EUR	970,000 BP Capital Markets Plc 1.109% 16/2/2023	1,101,728	0.06
EUR	1,605,000 BP Capital Markets Plc 1.526% 26/9/2022	1,835,730	0.09
GBP	105,000 CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	131,130	0.01
GBP	1,100,000 CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	1,411,215	0.07
GBP	220,000 CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	282,106	0.01
GBP	750,214 Compartment Driver UK Four FRN 25/3/2025	963,401	0.05
GBP	225,000 Finsbury Square 2020-1 Plc FRN 16/3/2070	289,138	0.01
GBP	620,000 Finsbury Square 2020-1 Plc FRN 16/3/2070	796,043	0.04
USD	600,000 HSBC Holdings Plc FRN 18/5/2024	637,179	0.03
USD	3,319,333 Lanark Master Issuer Plc FRN 22/12/2069	3,332,407	0.17
GBP	335,000 Lanark Master Issuer Plc 'Series 2020-1A 2A' '144A' FRN 22/12/2069	435,512	0.02
USD	200,000 MARB BondCo Plc 7% 15/3/2024	205,450	0.01
EUR	1,265,000 Motability Operations Group Plc 1.625% 9/6/2023	1,468,861	0.08
EUR	370,000 National Grid Electricity Transmission Plc 0.19% 20/1/2025	410,897	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP	5,073,586 Oat Hill No 1 Plc FRN 25/2/2046	6,511,395	0.33
GBP	375,000 Orbita Funding 2020-1 Plc FRN 17/3/2027	481,940	0.02
GBP	100,000 Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	128,627	0.01
GBP	115,000 Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	147,927	0.01
GBP	154,330 Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	198,262	0.01
GBP	100,000 Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	128,792	0.01
EUR	140,000 Rolls-Royce Plc 2.125% 18/6/2021	157,618	0.01
USD	2,650,000 Royal Bank of Scotland Group Plc 3.875% 12/9/2023	2,802,832	0.14
USD	2,235,000 Santander UK Group Holdings Plc FRN 5/1/2024	2,314,972	0.12
USD	475,000 Santander UK Group Holdings Plc 3.571% 10/1/2023	489,053	0.03
GBP	7,370,000 Silk Road Finance Number Six Plc FRN 21/9/2067	9,491,453	0.49
GBP	1,745,000 Silverstone Master Issuer Plc FRN 21/1/2070	2,240,165	0.12
EUR	515,000 Sky Ltd 1.5% 15/9/2021	579,879	0.03
GBP	3,218,806 Twin Bridges 2019-1 Plc FRN 12/12/2052	4,132,753	0.21
GBP	1,080,000 Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,582,574	0.08
		58,761,644	3.02
米国			
USD	2,073,000 1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 ' Series 2015-1211 A1A2 ' ' 144A ' 3.901% 10/8/2035	2,293,012	0.12
USD	1,865,000 280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust ' Series 2017-280P D ' ' 144A ' FRN 15/9/2034	1,874,042	0.10
EUR	930,000 3M Co 0.95% 15/5/2023	1,058,412	0.05
EUR	380,000 AbbVie Inc 1.375% 17/5/2024	433,882	0.02
USD	1,900,000 AbbVie Inc ' 144A ' 2.6% 21/11/2024	1,954,277	0.10
USD	995,000 AbbVie Inc ' 144A ' 2.95% 21/11/2026	1,029,921	0.05
USD	3,243,705 Adams Mill CLO Ltd ' Series 2014-1A A2R ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	3,247,204	0.17
USD	855,000 Air Lease Corp 2.625% 1/7/2022	867,342	0.04
USD	650,000 Allegro CLO II-S Ltd ' Series 2014-1RA B ' ' 144A ' FRN 21/10/2028	642,194	0.03
USD	6,325,000 Allergan Finance LLC (Restricted) 3.25% 1/10/2022	6,560,345	0.34
USD	1,300,000 Allergan Inc/United States (Restricted) 2.8% 15/3/2023	1,333,886	0.07
USD	2,815,000 Alliant Energy Finance LLC ' 144A ' 3.75% 15/6/2023	2,976,437	0.15
USD	4,500,000 ALM V Ltd ' Series 2012-5A A1R3 ' ' 144A ' FRN 18/10/2027	4,500,930	0.23
USD	1,857,808 ALM XII Ltd ' Series 2015-12A A1R2 ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	1,857,754	0.10
USD	8,000,000 ALM XVII Ltd ' Series 2015-17A A1AR ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	8,007,924	0.41

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
EUR 580,000	Altria Group Inc 1% 15/2/2023	650,798	0.03
EUR 315,000	Altria Group Inc 1.7% 15/6/2025	364,946	0.02
USD 4,950,000	Altria Group Inc 2.85% 9/8/2022	5,086,844	0.26
USD 1,495,000	Altria Group Inc 3.49% 14/2/2022	1,543,307	0.08
USD 2,030,000	Altria Group Inc 3.8% 14/2/2024	2,166,001	0.11
USD 678,203	American Airlines 2013-2 Class B Pass Through Trust ' 144A ' 5.6% 15/7/2020	686,695	0.04
USD 290,000	American Airlines Group Inc ' 144A ' 5% 1/6/2022	294,713	0.02
USD 915,000	American Express Co 2.5% 1/8/2022	932,814	0.05
EUR 1,035,000	American Honda Finance Corp 0.55% 17/3/2023	1,155,242	0.06
EUR 220,000	American Honda Finance Corp 1.375% 10/11/2022	250,599	0.01
EUR 715,000	American Tower Corp 1.95% 22/5/2026	856,521	0.04
USD 950,000	American Tower Corp 2.4% 15/3/2025	971,203	0.05
USD 2,300,000	American Tower Corp 3.45% 15/9/2021	2,360,030	0.12
USD 1,370,000	American Tower Corp 3.5% 31/1/2023	1,434,227	0.07
USD 1,239,042	AmericoId 2010 LLC ' Series 2010-ARTA A1 ' ' 144A ' 3.847% 14/1/2029	1,246,510	0.06
USD 192,715	AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017-2 ' Series 2017-2 A3 ' 1.98% 20/12/2021	192,767	0.01
USD 3,936,232	Americredit Automobile Receivables Trust 2018-1 ' Series 2018-1 A3 ' 3.07% 19/12/2022	3,966,164	0.20
USD 2,470,000	Americredit Automobile Receivables Trust 2018-2 ' Series 2018-2 A3 ' 3.15% 20/3/2023	2,500,732	0.13
USD 3,400,000	AMMC CLO XIII Ltd ' Series 2013-13A A1LR ' ' 144A ' FRN 24/7/2029	3,417,746	0.18
USD 335,000	Analog Devices Inc 2.85% 12/3/2020	335,098	0.02
USD 1,900,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.15% 23/1/2025	2,103,209	0.11
USD 1,110,000	Anthem Inc 3.125% 15/5/2022	1,144,173	0.06
USD 1,300,000	AOA 2015-1177 Mortgage Trust ' Series 2015-1177 D ' ' 144A ' FRN 13/12/2029	1,315,243	0.07
USD 887,000	Apache Corp 3.25% 15/4/2022	907,226	0.05
USD 168,000	Apache Corp 3.625% 1/2/2021	169,953	0.01
USD 1,300,000	Apache Corp 4.375% 15/10/2028	1,383,884	0.07
USD 1,350,000	Apache Corp 4.75% 15/4/2043	1,296,466	0.07
USD 1,350,000	Apache Corp 5.35% 1/7/2049	1,390,234	0.07
EUR 1,895,000	Apple Inc 1% 10/11/2022	2,150,566	0.11
USD 170,000	Arconic Rolled Products Corp ' 144A ' 6.125% 15/2/2028	176,423	0.01
USD 641,952	ARI Fleet Lease Trust 2017-A ' Series 2017-A A2 ' ' 144A ' 1.91% 15/4/2026	642,169	0.03
USD 5,245,000	ARI Fleet Lease Trust 2017-A ' Series 2017-A A3 ' ' 144A ' 2.28% 15/4/2026	5,272,034	0.27
USD 1,500,000	AT&T Inc 3.9% 11/3/2024	1,617,817	0.08
USD 1,100,000	AT&T Inc 3.95% 15/1/2025	1,197,954	0.06
USD 730,000	AvalonBay Communities Inc 2.3% 1/3/2030	736,753	0.04
USD 15,000,000	Aventura Mall Trust 2013-AVM ' Series 2013-AVM A ' ' 144A ' FRN 5/12/2032	15,081,424	0.78
USD 1,269,718	B2R Mortgage Trust 2015-2 ' Series 2015-2 A ' ' 144A ' 3.336% 15/11/2048	1,273,412	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,268,183	B2R Mortgage Trust 2016-1 'Series 2016-1 A' '144A' 2.567% 15/6/2049	3,278,252	0.17
USD 7,425,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 ' Series 2016-UB10 A2' 2.723% 15/7/2049	7,485,922	0.39
USD 22,567	Banc of America Mortgage 2003-J Trust 'Series 2003-J 2A1' ' FRN 25/11/2033	23,105	0.00
USD 3,555,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2021	3,564,796	0.18
USD 975,000	Bank of America Corp FRN 23/1/2022	984,448	0.05
USD 3,410,000	Bank of America Corp FRN 24/4/2023	3,488,203	0.18
USD 3,000,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2023	3,076,225	0.16
USD 8,100,000	Bank of America Corp FRN 20/12/2023	8,365,544	0.43
USD 6,900,000	Bank of America Corp FRN 23/7/2024	7,351,998	0.38
USD 6,665,000	Bank of America Corp 2.503% 21/10/2022	6,748,902	0.35
USD 3,755,000	Bank of America Corp 3.3% 11/1/2023	3,924,797	0.20
USD 405,000	Bank of America NA FRN 25/1/2023	417,959	0.02
USD 55,000	BAT Capital Corp 2.764% 15/8/2022	56,221	0.00
USD 7,800,000	BAT Capital Corp 2.789% 6/9/2024*	8,027,893	0.41
USD 1,880,000	BBCMS Trust 2013-TYSN 'Series 2013-TYSN E' '144A' 3.708% 5/9/2032	1,887,005	0.10
USD 8,506,000	Becton Dickinson and Co FRN 29/12/2020*	8,511,245	0.44
EUR 885,000	Becton Dickinson and Co 1.401% 24/5/2023	1,008,729	0.05
USD 2,040,000	Becton Dickinson and Co 2.404% 5/6/2020	2,043,249	0.11
USD 10,000,000	BellSouth LLC '144A' 4.266% 26/4/2020	10,040,350	0.52
USD 2,000,000	Benefit Street Partners CLO II Ltd 'Series 2013-IIA A2R' ' '144A' FRN 15/7/2029	1,994,536	0.10
USD 520,000	Benefit Street Partners CLO V-B Ltd 'Series 2018-5BA A1A' ' '144A' FRN 20/4/2031	519,871	0.03
USD 870,000	Black Diamond CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A A2R' ' 144A' FRN 6/2/2026	869,237	0.04
USD 765,000	Bristol-Myers Squibb Co '144A' 2.75% 15/2/2023	790,407	0.04
USD 3,564,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3% 15/1/2022	3,630,923	0.19
USD 2,148,740	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND 'Series 2018-IND A' ' '144A' FRN 15/11/2035	2,149,978	0.11
USD 6,400,000	Capital One Bank USA NA FRN 27/1/2023	6,444,567	0.33
USD 1,485,000	Capital One Financial Corp 2.4% 30/10/2020	1,492,989	0.08
USD 5,155,000	Capital One Financial Corp 3.05% 9/3/2022	5,279,868	0.27
USD 2,335,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 Ltd 'Series 2014-5A A1RR' '144A' FRN 15/7/2031	2,338,595	0.12
USD 2,000,000	Carrier Global Corp '144A' 2.242% 15/2/2025	2,026,712	0.10
USD 1,309,215	Catamaran CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A AR' '144A' FRN 22/4/2027	1,308,094	0.07
USD 1,095,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT 'Series 2016- HEAT A' '144A' 3.357% 10/4/2029	1,106,004	0.06
USD 5,000,000	CD 2016-CD1 Mortgage Trust 'Series 2016-CD1 ASB' 2.622% 10/8/2049	5,170,772	0.27
USD 4,350,000	CD 2018-CD7 Mortgage Trust 'Series 2018-CD7 A4' 4.279% 15/8/2051	5,076,012	0.26
USD 6,580,000	Cedar Funding VI CLO Ltd 'Series 2016-6A AR' '144A' FRN 20/10/2028	6,592,613	0.34

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国 (続き)		
USD 1,820,000	CenterPoint Energy Inc 2.5% 1/9/2022	1,856,505	0.10
USD 1,896,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 ' Series 2016- C4 ASB ' 3.091% 10/5/2058	1,991,334	0.10
USD 2,877,662	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-B10C ' Series 2017- B10C A ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	2,880,018	0.15
USD 633,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.5% 1/2/2024	688,661	0.04
USD 2,353,097	Chesapeake Funding II LLC ' Series 2017-2A A2 ' ' 144A ' FRN 15/5/2029	2,355,671	0.12
USD 1,014,445	Chesapeake Funding II LLC ' Series 2017-3A A2 ' ' 144A ' FRN 15/8/2029	1,015,309	0.05
USD 214,034	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 ' Series 2005- HYB8 2A1 ' FRN 20/12/2035	194,926	0.01
EUR 340,000	Chubb INA Holdings Inc 0.3% 15/12/2024	374,844	0.02
USD 1,975,000	Cifc Funding 2014-IV-R Ltd ' Series 2014-4RA A1A ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	1,975,727	0.10
USD 5,687,135	CIFC Funding 2015-II Ltd ' Series 2015-2A AR ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	5,689,713	0.29
USD 4,735,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P ' Series 2013-375P A ' ' 144A ' 3.251% 10/5/2035	4,954,791	0.26
USD 4,105,233	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC11 ' Series 2013-GC11 A3 ' 2.815% 10/4/2046	4,234,281	0.22
USD 5,879,506	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 ' Series 2014-GC19 AAB ' 3.552% 10/3/2047	6,113,040	0.31
USD 115,000	Citigroup Inc FRN 24/1/2023	117,854	0.01
EUR 1,020,000	Citigroup Inc 0.75% 26/10/2023	1,141,836	0.06
USD 3,000,000	Citizens Bank NA/Providence RI 3.7% 29/3/2023	3,177,970	0.16
EUR 1,830,000	Coca-Cola Co/The 1.125% 22/9/2022	2,076,886	0.11
USD 2,242,144	COMM 2005-C6 Mortgage Trust ' Series 2005-C6 F ' ' 144A ' FRN 10/6/2044	2,265,715	0.12
USD 3,494,385	COMM 2013-CCRE7 Mortgage Trust ' Series 2013-CR7 ASB ' 2.739% 10/3/2046	3,557,658	0.18
USD 406,269	COMM 2013-GAM ' Series 2013-GAM A1 ' ' 144A ' 1.705% 10/2/2028	405,366	0.02
USD 933,242	COMM 2013-LC6 Mortgage Trust ' Series 2013-LC6 ASB ' 2.478% 10/1/2046	943,780	0.05
USD 585,032	COMM 2013-SFS Mortgage Trust ' Series 2013-SFS A1 ' ' 144A ' 1.873% 12/4/2035	587,415	0.03
USD 3,000,000	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust ' Series 2014- CR18 A5 ' 3.828% 15/7/2047	3,258,226	0.17
USD 6,324,083	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust ' Series 2014-UBS3 ASB ' 3.367% 10/6/2047	6,536,740	0.34
USD 2,518,230	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust ' Series 2014-UBS5 ASB ' 3.548% 10/9/2047	2,612,122	0.13
USD 4,450,000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust ' Series 2015-3BP A ' ' 144A ' 3.178% 10/2/2035	4,767,858	0.25
USD 1,618,353	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust ' Series 2015- CR22 A2 ' 2.856% 10/3/2048	1,617,681	0.08
USD 9,432,262	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' Series 2015- CR23 XA ' FRN 10/5/2048	338,067	0.02
USD 2,655,000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust ' Series 2015- CR24 ASB ' 3.445% 10/8/2048	2,779,467	0.14
USD 3,192,746	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust ' Series 2015-LC21 A2 ' 2.976% 10/7/2048	3,196,999	0.16

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高		銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)				
USD	4,100,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 'Series 2015-LC21 ASB' 3.421% 10/7/2048	4,285,862	0.22
USD	2,061,000	Conagra Brands Inc FRN 22/10/2020	2,061,273	0.11
USD	3,220,000	Concho Resources Inc 4.375% 15/1/2025	3,332,747	0.17
USD	258	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	265	0.00
USD	980,000	Continental Resources Inc/OK 3.8% 1/6/2024	990,803	0.05
USD	1,895,000	Cox Communications Inc '144A' 3.15% 15/8/2024	1,988,690	0.10
USD	8,160,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.01% 16/2/2027	8,207,965	0.42
USD	9,890,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-2 'Series 2018-2A A' '144A' 3.47% 17/5/2027	10,047,680	0.52
USD	4,760,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-3 'Series 2018-3A A' '144A' 3.55% 15/8/2027	4,856,649	0.25
USD	635,000	Crown Castle International Corp 3.2% 1/9/2024	667,199	0.03
USD	1,645,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust 'Series 2015- C1 A4' 3.505% 15/4/2050	1,777,783	0.09
USD	4,225,976	CSWF 2018-TOP 'Series 2018-TOP A' '144A' FRN 15/8/2035	4,231,224	0.22
USD	1,500,000	CVS Health Corp 3.7% 9/3/2023	1,580,614	0.08
USD	2,450,000	CVS Health Corp 4.1% 25/3/2025	2,671,841	0.14
USD	1,490,000	Daimler Finance North America LLC '144A' 3.35% 4/5/2021	1,516,326	0.08
USD	4,640,695	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 'Series 2018-BIOD A' ' 144A' FRN 15/5/2035	4,643,014	0.24
USD	2,076,000	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 'Series 2018-GLKS A' ' 144A' FRN 19/11/2035	2,081,701	0.11
USD	1,575,000	Delta Air Lines Inc 2.6% 4/12/2020	1,585,403	0.08
USD	2,115,000	Delta Air Lines Inc 2.875% 13/3/2020	2,115,261	0.11
USD	2,180,000	Diamondback Energy Inc 2.875% 1/12/2024	2,205,534	0.11
USD	2,300,000	Diamondback Energy Inc 3.5% 1/12/2029	2,300,052	0.12
USD	1,000,000	Discover Bank 3.35% 6/2/2023	1,041,385	0.05
USD	2,800,000	Discovery Communications LLC 3.3% 15/5/2022	2,886,455	0.15
USD	1,265,000	Discovery Communications LLC 4.375% 15/6/2021	1,307,221	0.07
USD	830,000	Dominion Energy Inc 2.579% 1/7/2020	831,512	0.04
USD	2,790,000	Dominion Energy Inc (Step-up coupon) 2.715% 15/8/2021	2,829,451	0.15
USD	3,600,000	Dow Chemical Co/The 3% 15/11/2022	3,738,587	0.19
USD	2,835,000	Duke Energy Corp 3.95% 15/10/2023	3,040,069	0.16
USD	2,400,000	DuPont de Nemours Inc 4.205% 15/11/2023	2,608,321	0.13
USD	1,215,000	Energy Transfer Operating LP 2.9% 15/5/2025	1,235,735	0.06
USD	1,250,000	Energy Transfer Operating LP 3.6% 1/2/2023	1,292,801	0.07
USD	5,275,000	Energy Transfer Operating LP 4.25% 15/3/2023	5,549,311	0.29
USD	1,435,000	Energy Transfer Operating LP 4.5% 15/4/2024	1,552,276	0.08
USD	4,400,000	Energy Transfer Operating LP 5.875% 15/1/2024	4,913,222	0.25
USD	71,280	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2017-1 A2' ' 144A' 2.13% 20/7/2022	71,320	0.00
USD	4,523,076	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2018-1 A2' ' 144A' 2.87% 20/10/2023	4,553,447	0.23
USD	2,955,000	Equinix Inc 2.625% 18/11/2024	3,023,925	0.16

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 510,446	Exantas Capital Corp 2018- RS06 Ltd ' Series 2018-RS06 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2035	509,514	0.03
USD 2,125,000	Exelon Corp 2.45% 15/4/2021	2,137,714	0.11
USD 2,400,000	Express Scripts Holding Co 2.6% 30/11/2020	2,417,373	0.12
USD 207,256	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017- C02 2M1 ' FRN 25/9/2029	207,328	0.01
USD 666,753	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017- C04 2M1 ' FRN 25/11/2029	666,898	0.03
USD 357,155	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017- C07 1M1 ' FRN 25/5/2030	357,190	0.02
USD 56,711	Fannie Mae Pool ' AB4997 ' 3% 1/4/2027	58,667	0.00
USD 207	Fannie Mae Pool ' AD0454 ' 5% 1/11/2021	210	0.00
USD 6,371	Fannie Mae Pool ' AE0812 ' 5% 1/7/2025	6,478	0.00
USD 1,481,870	Fannie Mae Pool ' AL4364 ' FRN 1/9/2042	1,518,664	0.08
USD 68,576	Fannie Mae Pool ' AL7139 ' 3% 1/7/2030	71,782	0.00
USD 48,511	Fannie Mae Pool ' AL7227 ' 3% 1/8/2030	50,636	0.00
USD 574,397	Fannie Mae Pool ' AL9376 ' 3% 1/8/2031	601,002	0.03
USD 58,283	Fannie Mae Pool ' AL9378 ' 3% 1/9/2031	61,210	0.00
USD 344,607	Fannie Mae Pool ' AL9899 ' 3% 1/3/2032	360,247	0.02
USD 26,167	Fannie Mae Pool ' AS5622 ' 3% 1/8/2030	27,392	0.00
USD 92,971	Fannie Mae Pool ' AS5728 ' 3% 1/9/2030	97,362	0.01
USD 843,508	Fannie Mae Pool ' AS5794 ' 3% 1/9/2030	881,724	0.05
USD 88,304	Fannie Mae Pool ' AS8604 ' 3% 1/1/2032	92,416	0.00
USD 1,987,549	Fannie Mae Pool ' AS8980 ' 4.5% 1/3/2047	2,167,376	0.11
USD 6,385,569	Fannie Mae Pool ' AS9610 ' 4.5% 1/5/2047	6,971,127	0.36
USD 69,967	Fannie Mae Pool ' AU0967 ' 3% 1/8/2028	72,376	0.00
USD 2,753,678	Fannie Mae Pool ' AX0000 ' FRN 1/9/2044	2,850,933	0.15
USD 665,394	Fannie Mae Pool ' AX5552 ' 3% 1/10/2031	691,530	0.04
USD 321,617	Fannie Mae Pool ' AY4218 ' 3% 1/5/2030	333,221	0.02
USD 816,655	Fannie Mae Pool ' AY6268 ' 3% 1/3/2030	846,164	0.04
USD 119,154	Fannie Mae Pool ' AZ4080 ' 3% 1/12/2031	124,926	0.01
USD 609,910	Fannie Mae Pool ' AZ5005 ' 3% 1/12/2030	631,896	0.03
USD 72,845	Fannie Mae Pool ' AZ5798 ' 3% 1/9/2030	75,414	0.00
USD 36,759	Fannie Mae Pool ' BA0776 ' 3% 1/9/2030	38,260	0.00
USD 25,990	Fannie Mae Pool ' BA2882 ' 3% 1/11/2030	26,887	0.00
USD 690,941	Fannie Mae Pool ' BA5803 ' 3% 1/12/2030	716,655	0.04
USD 576,566	Fannie Mae Pool ' BC0853 ' 3% 1/4/2031	600,697	0.03
USD 98,716	Fannie Mae Pool ' BC1707 ' 3% 1/1/2031	102,272	0.01
USD 38,897	Fannie Mae Pool ' BC1774 ' 3% 1/1/2031	40,300	0.00
USD 85,847	Fannie Mae Pool ' BC4017 ' 3% 1/3/2031	88,806	0.00
USD 92,400	Fannie Mae Pool ' BC4263 ' 3% 1/5/2031	96,411	0.00
USD 69,064	Fannie Mae Pool ' BC7657 ' 3% 1/4/2031	72,059	0.00
USD 29,262	Fannie Mae Pool ' BD1996 ' 3% 1/8/2031	30,317	0.00
USD 87,471	Fannie Mae Pool ' BD4404 ' 3% 1/7/2031	90,931	0.00
USD 467,923	Fannie Mae Pool ' BD6154 ' 3% 1/11/2031	486,292	0.03
USD 566,321	Fannie Mae Pool ' BE3155 ' 3% 1/1/2032	591,239	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD	804,539 Fannie Mae Pool ' BE6942 ' 3% 1/2/2032	839,196	0.04
USD	46,287 Fannie Mae Pool ' BH2512 ' 3% 1/7/2032	48,383	0.00
USD	669,576 Fannie Mae Pool ' BH4308 ' 3% 1/6/2032	697,476	0.04
USD	24,666 Fannie Mae Pool ' BH5232 ' 3% 1/7/2032	25,505	0.00
USD	774,567 Fannie Mae Pool ' BH5623 ' 3% 1/6/2032	812,191	0.04
USD	390,642 Fannie Mae Pool ' BH6399 ' 3% 1/11/2032	405,085	0.02
USD	473,736 Fannie Mae Pool ' BH6518 ' 3% 1/9/2032	492,304	0.03
USD	2,648,670 Fannie Mae Pool ' BJ2716 ' 4% 1/4/2033	2,837,864	0.15
USD	23,024 Fannie Mae Pool ' BJ2995 ' 3% 1/1/2033	24,155	0.00
USD	116,391 Fannie Mae Pool ' BJ3883 ' 3% 1/1/2033	121,449	0.01
USD	117,958 Fannie Mae Pool ' BJ4268 ' 3% 1/12/2032	123,085	0.01
USD	32,316 Fannie Mae Pool ' BJ4734 ' 3% 1/12/2032	33,719	0.00
USD	64,159 Fannie Mae Pool ' BJ5289 ' 3% 1/2/2033	67,071	0.00
USD	761,422 Fannie Mae Pool ' BJ9249 ' 4.5% 1/6/2048	854,625	0.04
USD	57,819 Fannie Mae Pool ' BK7893 ' 3% 1/10/2033	60,436	0.00
USD	540,642 Fannie Mae Pool ' BK9849 ' 4% 1/9/2033	584,678	0.03
USD	665,727 Fannie Mae Pool ' BM1775 ' 4.5% 1/7/2047	731,089	0.04
USD	7,288,136 Fannie Mae Pool ' BM3280 ' 4.5% 1/11/2047	7,958,684	0.41
USD	347,564 Fannie Mae Pool ' BM3947 ' 3% 1/1/2033	360,349	0.02
USD	2,457,185 Fannie Mae Pool ' BM5082 ' 4.5% 1/11/2048	2,747,071	0.14
USD	6,438,010 Fannie Mae Pool ' BM5568 ' 4.5% 1/2/2049	7,305,829	0.38
USD	893,359 Fannie Mae Pool ' BN5294 ' 4% 1/2/2034	963,814	0.05
USD	76,253 Fannie Mae Pool ' BN5357 ' 4% 1/3/2034	81,486	0.00
USD	487,692 Fannie Mae Pool ' BN5360 ' 4% 1/3/2034	522,549	0.03
USD	1,674,432 Fannie Mae Pool ' BN5404 ' 4.5% 1/4/2049	1,894,551	0.10
USD	197,901 Fannie Mae Pool ' BN6416 ' 3.5% 1/4/2034	211,124	0.01
USD	986,326 Fannie Mae Pool ' BN6570 ' 3.5% 1/4/2034	1,051,996	0.05
USD	807,420 Fannie Mae Pool ' CA0780 ' 3% 1/11/2032	844,102	0.04
USD	414,744 Fannie Mae Pool ' CA1095 ' 3% 1/2/2033	435,538	0.02
USD	1,956,463 Fannie Mae Pool ' CA1937 ' 4% 1/6/2033	2,101,693	0.11
USD	531,170 Fannie Mae Pool ' CA3287 ' 4% 1/3/2034	563,836	0.03
USD	20,247,994 Fannie Mae Pool ' FM1245 ' 4% 1/9/2033	21,287,652	1.10
USD	18,141 Fannie Mae Pool ' MA0909 ' 3% 1/11/2021	18,736	0.00
USD	599,970 Fannie Mae Pool ' MA2561 ' 3% 1/3/2031	621,585	0.03
USD	113,417 Fannie Mae Pool ' MA2684 ' 3% 1/7/2031	117,502	0.01
USD	37,150 Fannie Mae Pool ' MA3090 ' 3% 1/8/2032	38,514	0.00
EUR	1,530,000 Fidelity National Information Services Inc 0.125% 3/12/2022	1,686,111	0.09
EUR	2,385,000 Fidelity National Information Services Inc 0.4% 15/1/2021	2,626,610	0.14
EUR	1,945,000 Fidelity National Information Services Inc 0.75% 21/5/2023*	2,178,418	0.11
USD	990,000 Fifth Third Bancorp 2.6% 15/6/2022	1,013,397	0.05
USD	950,000 Fifth Third Bank/Cincinnati OH 1.8% 30/1/2023	956,740	0.05
USD	1,330,000 FirstEnergy Corp 2.85% 15/7/2022	1,365,631	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 11,462,000	Ford Credit Auto Owner Trust 2018-B 'Series 2018-B A4' 3.38% 15/3/2024	11,944,097	0.61
USD 3,850,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 'Series 2017- 2 A1' 2.16% 15/9/2022	3,858,475	0.20
USD 3,500,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.157% 4/8/2020	3,516,479	0.18
USD 3,645,000	Ford Motor Credit Co LLC 4.063% 1/11/2024	3,715,230	0.19
USD 1,895,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.085% 7/1/2021	1,941,680	0.10
USD 3,176,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18/3/2024	3,418,922	0.18
USD 5,661,477	Freddie Mac Gold Pool 'G15602' 2.5% 1/11/2027	5,867,340	0.30
USD 2,323,236	Freddie Mac Gold Pool 'G16763' 4% 1/2/2034	2,489,973	0.13
USD 3,015,762	Freddie Mac Gold Pool 'G16789' 4% 1/2/2034	3,255,514	0.17
USD 2,437,446	Freddie Mac Gold Pool 'G16792' 4% 1/3/2034	2,637,800	0.14
USD 556,362	Freddie Mac Gold Pool 'G61047' 4.5% 1/7/2047	615,196	0.03
USD 28,100,750	Freddie Mac Gold Pool 'G67720' 4.5% 1/3/2049	31,501,825	1.62
USD 106,350,024	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/9/2024	3,044,301	0.16
USD 1,941,934	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 2.158% 25/10/2021	1,961,191	0.10
USD 2,890,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 3.065% 25/8/2022	2,978,391	0.15
USD 5,732,259	Freddie Mac Non Gold Pool '849692' FRN 1/5/2045	5,946,395	0.31
USD 2,958,798	Freddie Mac REMICS 'Series 4459 BN' 3% 15/8/2043	3,096,852	0.16
USD 3,635,664	Freddie Mac REMICS 'Series 4748 HC' 3% 15/1/2044	3,752,226	0.19
USD 2,575,720	Freddie Mac REMICS 'Series 4286 MP' 4% 15/12/2043	2,777,432	0.14
USD 222,448	Freddie Mac REMICS 'Series 3986 M' 4.5% 15/9/2041	235,607	0.01
USD 165,240	Freddie Mac REMICS 'Series 3959 MA' 4.5% 15/11/2041	179,081	0.01
USD 3,273,988	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA2 M1' FRN 25/10/2029	3,285,903	0.17
EUR 360,000	General Mills Inc 0.45% 15/1/2026	399,456	0.02
USD 4,261,000	General Motors Financial Co Inc 3.2% 6/7/2021	4,322,155	0.22
USD 2,435,000	General Motors Financial Co Inc 3.7% 24/11/2020	2,461,779	0.13
USD 3,190,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 1/3/2021	3,248,267	0.17
USD 1,610,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 6/11/2021	1,667,239	0.09
USD 420,000	Global Payments Inc 3.75% 1/6/2023	443,282	0.02
USD 1,350,000	Global Payments Inc 4% 1/6/2023	1,440,768	0.07
USD 1,000,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd 'Series 2015-11A AR2' '144A' FRN 18/1/2031	1,000,389	0.05
EUR 1,220,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 21/4/2023	1,346,427	0.07
USD 3,041,300	Gosforth Funding 2018-1 plc 'Series 2018-1A A1' '144A' ' FRN 25/8/2060	3,040,751	0.16
USD 8,051,630	Government National Mortgage Association 'Series 2012- 120 IO' FRN 16/2/2053	378,679	0.02
USD 4,279,781	Government National Mortgage Association 'Series 2018-36 AM' 3% 20/7/2045	4,406,060	0.23
USD 13,350,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust 'Series 2014-GRCE A' ' 144A' 3.369% 10/6/2028	13,543,870	0.70
USD 3,375,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K 'Series 2017-500K A' '144A' FRN 15/7/2032	3,373,705	0.17

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,495,000	GS Mortgage Securities Trust 2011-GC5 ' Series 2011-GC5 AS ' ' 144A ' FRN 10/8/2044	2,584,076	0.13
USD 4,818,938	GS Mortgage Securities Trust 2012-GCJ7 ' Series 2012-GCJ7 A4 ' 3.377% 10/5/2045	4,904,870	0.25
USD 2,636,467	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16 ' Series 2013-GC16 AAB ' 3.813% 10/11/2046	2,747,591	0.14
USD 3,955,603	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16 ' Series 2013-GC16 A3 ' 4.244% 10/11/2046	4,260,458	0.22
USD 3,495,242	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 ' Series 2014-GC18 A4 ' 4.074% 10/1/2047	3,779,074	0.19
USD 6,361,000	GS Mortgage Securities Trust 2016-GS3 ' Series 2016-GS3 AAB ' 2.777% 10/10/2049	6,609,001	0.34
USD 3,247,372	Halcyon Loan Advisors Funding 2015-2 Ltd ' Series 2015-2A AR ' ' 144A ' FRN 25/7/2027	3,242,621	0.17
USD 1,500,000	Halliburton Co (Restricted) 3.8% 15/11/2025	1,640,242	0.08
USD 1,100,000	Halliburton Co 5% 15/11/2045	1,213,826	0.06
USD 3,350,000	Hewlett Packard Enterprise Co 3.6% 15/10/2020	3,378,249	0.17
USD 3,686,032	Holmes Master Issuer Plc ' Series 2018-2A A2 ' ' 144A ' FRN 15/10/2054	3,688,133	0.19
EUR 2,920,000	Honeywell International Inc 1.3% 22/2/2023	3,335,969	0.17
USD 1,925,000	Huntington National Bank/The 1.8% 3/2/2023	1,939,682	0.10
USD 3,260,000	Huntington National Bank/The 2.875% 20/8/2020	3,276,168	0.17
USD 1,290,000	Huntington National Bank/The 3.125% 1/4/2022	1,329,092	0.07
USD 1,575,000	Hyundai Capital America ' 144A ' 2.55% 3/4/2020	1,577,953	0.08
USD 1,750,000	ICG US CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A A1R ' ' 144A ' FRN 19/10/2028	1,751,046	0.09
EUR 945,000	Illinois Tool Works Inc 0.25% 5/12/2024	1,049,304	0.05
USD 3,151,000	International Lease Finance Corp 4.625% 15/4/2021	3,247,080	0.17
USD 1,455,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 3.5% 1/10/2020	1,470,470	0.08
USD 500,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 3.75% 1/10/2021	514,541	0.03
USD 900,000	ITC Holdings Corp 2.7% 15/11/2022	923,851	0.05
USD 3,780,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-BCON ' Series 2018- BCON A ' ' 144A ' 3.735% 5/1/2031	3,970,002	0.20
USD 620,000	John Deere Capital Corp 2.6% 7/3/2024	643,380	0.03
USD 2,205,793	John Deere Owner Trust 2017- B ' Series 2017-B A3 ' 1.82% 15/10/2021	2,207,580	0.11
USD 3,236,814	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2011-C4 ' Series 2011-C4 A4 ' ' 144A ' 4.388% 15/7/2046	3,308,855	0.17
USD 4,787,207	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-CIBX ' Series 2012-CBX A4 ' 3.483% 15/6/2045	4,905,926	0.25
USD 3,615,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-HSBC ' Series 2012- HSBC D ' ' 144A ' FRN 5/7/2032	3,801,605	0.20
USD 3,099,316	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C16 ' Series 2013-C16 ASB ' 3.674% 15/12/2046	3,208,343	0.17
USD 4,695,257	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013-LC11 ' Series 2013- LC11 ASB ' 2.554% 15/4/2046	4,769,159	0.25

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,889,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-JP2 'Series 2016-JP2 ASB' 2.713% 15/8/2049	4,023,184	0.21
USD 3,250,188	JP Morgan Mortgage Trust 2016-2 'Series 2016-2 A1' '144A' FRN 25/6/2046	3,277,674	0.17
USD 3,758,610	JP Morgan Mortgage Trust 2017-1 'Series 2017-1 A4' '144A' FRN 25/1/2047	3,895,203	0.20
USD 8,323,154	JP Morgan Mortgage Trust 2017-3 'Series 2017-3 1A6' '144A' FRN 25/8/2047	8,474,011	0.44
USD 6,592,092	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17 'Series 2013-C17 ASB' 3.705% 15/1/2047	6,875,068	0.35
USD 3,475,657	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 'Series 2014-C23 ASB' 3.657% 15/9/2047	3,631,636	0.19
USD 991,540	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C26 'Series 2014-C26 ASB' 3.288% 15/1/2048	1,027,598	0.05
USD 3,380,000	JPMorgan Chase & Co FRN 18/6/2022	3,402,326	0.18
USD 6,115,000	JPMorgan Chase & Co FRN 25/4/2023	6,247,643	0.32
USD 2,305,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2024	2,427,674	0.12
USD 1,800,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2024	1,917,691	0.10
EUR 430,000	JPMorgan Chase & Co 2.625% 23/4/2021	486,898	0.03
USD 900,000	Keurig Dr Pepper Inc 4.057% 25/5/2023	962,868	0.05
USD 2,500,000	KeyBank NA/Cleveland OH 2.25% 16/3/2020	2,500,604	0.13
USD 365,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 4.25% 1/9/2024	398,176	0.02
USD 2,715,000	Kinder Morgan Inc/DE '144A' 5% 15/2/2021	2,788,904	0.14
USD 2,400,000	Kraft Heinz Foods Co 3.95% 15/7/2025	2,491,696	0.13
USD 1,155,000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 4.875% 15/2/2025	1,188,372	0.06
USD 7,600,000	Lam Research Corp 3.75% 15/3/2026	8,358,466	0.43
USD 6,790,000	Lendmark Funding Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.81% 21/12/2026	6,955,074	0.36
USD 1,645,644	LFRF '2015-1' '144A' 4% 30/10/2027	1,640,441	0.08
USD 1,385,000	Madison Avenue Trust 2013- 650M 'Series 2013-650M A' '144A' 3.843% 12/10/2032	1,392,187	0.07
USD 2,700,000	Marathon Oil Corp 4.4% 15/7/2027	2,930,005	0.15
USD 2,590,000	Marsh & McLennan Cos Inc 3.5% 10/3/2025	2,781,142	0.14
EUR 1,550,000	Mastercard Inc 1.1% 1/12/2022	1,760,489	0.09
EUR 500,000	McDonald's Corp 1% 15/11/2023	570,151	0.03
EUR 1,100,000	McDonald's Corp 1.125% 26/5/2022	1,242,119	0.06
USD 9,820,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2017-B 'Series 2017-BA A' '144A' FRN 16/5/2022	9,827,976	0.51
USD 4,595,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2018-BA 'Series 2018-BA A' '144A' FRN 15/5/2023	4,603,452	0.24
EUR 190,000	Metropolitan Life Global Funding I 23/9/2022 (Zero Coupon)	208,628	0.01
EUR 500,000	Metropolitan Life Global Funding I 0.375% 9/4/2024	555,215	0.03
EUR 310,000	Metropolitan Life Global Funding I 2.375% 11/1/2023	362,924	0.02
USD 3,140,818	Mill City Mortgage Loan Trust 2016-1 'Series 2016-1 A1' '144A' FRN 25/4/2057	3,164,930	0.16
USD 1,334,945	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust2013-C10 'Series 2013-C10 ASB' FRN 15/7/2046	1,377,790	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust2013-C13 'Series 2013-C13 A4' 4.039% 15/11/2046	3,762,497	0.19
USD 3,163,220	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust2013-C9 'Series 2013-C9 AAB' 2.657% 15/5/2046	3,208,320	0.17
USD 3,516,567	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust2014-C18 'Series 2014-C18 ASB' 3.621% 15/10/2047	3,656,702	0.19
USD 5,385,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust2015-C25 'Series 2015-C25 ASB' 3.383% 15/10/2048	5,672,265	0.29
USD 3,438,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust2016-C30 'Series 2016-C30 ASB' 2.729% 15/9/2049	3,574,769	0.18
USD 5,900,000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 'Series 2017-HR2 A4' 3.587% 15/12/2050	6,543,956	0.34
USD 1,659,795	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-T0P27 'Series 2007-T27 AJ' FRN 11/6/2042	1,759,181	0.09
USD 4,940,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-MP 'Series 2014-MP A' '144A' 3.469% 11/8/2033	5,052,912	0.26
USD 4,176,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 'Series 2018-L1 A4' FRN 15/10/2051	4,921,268	0.25
USD 1,945,000	MPLX LP FRN 9/9/2021	1,951,798	0.10
USD 1,995,000	MPLX LP '144A' 3.5% 1/12/2022	2,077,267	0.11
USD 1,435,000	MPLX LP '144A' 6.25% 15/10/2022	1,458,853	0.08
USD 731,401	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-AA A2B' '144A' FRN 15/2/2029	737,058	0.04
USD 1,181,212	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-AA A2A' '144A' 2.74% 15/2/2029	1,196,854	0.06
USD 16,107	Navient Private Education Loan Trust 2014-CT 'Series 2014-CTA A' '144A' FRN 16/9/2024	16,111	0.00
USD 1,446,493	Navient Private Education Loan Trust 2018-B 'Series 2018-BA A1' '144A' FRN 15/12/2059	1,446,826	0.07
USD 620,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-A 'Series 2020-A A2B' '144A' FRN 15/11/2068	621,796	0.03
USD 2,000,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-A 'Series 2020-A B' '144A' 3.16% 15/11/2068	2,097,374	0.11
USD 897,000	Navient Student Loan Trust 2018-EA 'Series 2018-EA A2' '144A' 4% 15/12/2059	943,546	0.05
USD 4,540,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd 'Series 2015-20A AR' '144A' FRN 15/1/2028	4,542,154	0.23
USD 12,870,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd 'Series 2017-26A A' '144A' FRN 18/10/2030	12,879,536	0.66
USD 744,768	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 'Series 2016-3A A1B' '144A' FRN 25/9/2056	776,756	0.04
USD 3,424,540	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1 'Series 2018-1A A1A' '144A' FRN 25/12/2057	3,635,070	0.19
USD 3,850,000	Newfield Exploration Co 5.625% 1/7/2024	4,242,591	0.22
USD 2,925,000	Nissan Motor Acceptance Corp '144A' 2.125% 3/3/2020	2,925,059	0.15
USD 75,294	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	77,880	0.00
USD 560,000	Occidental Petroleum Corp 2.6% 13/8/2021	565,631	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 665,000	Occidental Petroleum Corp 2.7% 15/8/2022	677,370	0.03
USD 5,700,000	Occidental Petroleum Corp 2.9% 15/8/2024	5,833,794	0.30
USD 7,525,000	OneMain Direct Auto Receivables Trust 2018-1 ' Series 2018-1A A ' ' 144A ' 3.43% 16/12/2024	7,641,760	0.39
USD 1,415,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 ' Series 2018-1A A ' ' 144A ' 3.3% 14/3/2029	1,446,012	0.07
USD 1,900,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 ' Series 2019-2A A ' ' 144A ' 3.14% 14/10/2036	1,976,058	0.10
USD 1,015,000	Otis Worldwide Corp ' 144A ' 2.056% 5/4/2025	1,026,911	0.05
USD 2,175,000	Ovintiv Inc 3.9% 15/11/2021	2,237,407	0.12
USD 575,000	Parker-Hannifin Corp 2.7% 14/6/2024	597,896	0.03
USD 1,450,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 2.7% 14/3/2023	1,489,734	0.08
USD 855,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 2.7% 1/11/2024	884,749	0.05
USD 4,635,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 4.125% 1/8/2023	4,973,339	0.26
USD 1,075,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 4.25% 17/1/2023	1,149,073	0.06
USD 3,630,000	PFS Financing Corp ' Series 2018-B A ' ' 144A ' 2.89% 15/2/2023	3,676,852	0.19
USD 2,830,000	PFS Financing Corp ' Series 2018-D A ' ' 144A ' 3.19% 17/4/2023	2,882,085	0.15
USD 9,430,000	PFS Financing Corp ' Series 2018-F A ' ' 144A ' 3.52% 15/10/2023	9,692,666	0.50
EUR 170,000	Philip Morris International Inc 0.125% 3/8/2026	182,910	0.01
EUR 280,000	Philip Morris International Inc 2.875% 3/3/2026	351,524	0.02
USD 1,445,000	Pricoa Global Funding I ' 144A ' 2.45% 21/9/2022	1,476,085	0.08
EUR 210,000	Procter & Gamble Co/The 0.625% 30/10/2024	239,175	0.01
USD 812,000	Rockwell Collins Inc 2.8% 15/3/2022	832,275	0.04
USD 2,455,000	Rosslyn Portfolio Trust 2017- ROSS ' Series 2017-ROSS B ' ' 144A ' FRN 15/6/2033	2,455,637	0.13
USD 3,240,000	Ryder System Inc 2.5% 1/9/2024	3,303,269	0.17
USD 885,000	Ryder System Inc 2.875% 1/9/2020	888,570	0.05
USD 782,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/5/2024	877,012	0.05
USD 700,000	Santander Holdings USA Inc 3.5% 7/6/2024	736,107	0.04
USD 1,535,000	Santander Holdings USA Inc 3.7% 28/3/2022	1,593,291	0.08
USD 5,403,051	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2019-4 ' Series 2019-4 MA ' 3% 25/2/2059	5,655,285	0.29
USD 2,755,000	Sempra Energy FRN 15/1/2021	2,755,810	0.14
USD 2,446,168	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH1 ' Series 2017-CH1 A2 ' ' 144A ' FRN 25/8/2047	2,519,679	0.13
USD 1,124,616	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH2 ' Series 2017-CH2 A10 ' ' 144A ' FRN 25/12/2047	1,137,307	0.06
USD 766,150	Sesac Finance LLC ' Series 2019-1 A2 ' ' 144A ' 5.216% 25/7/2049	816,009	0.04
USD 8,050,000	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A ' Series 2005-A A4 ' FRN 15/12/2038	7,868,523	0.40
USD 6,242,147	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B ' Series 2005-B A4 ' FRN 15/6/2039	6,144,922	0.32
USD 4,260,818	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A ' Series 2006-A A5 ' FRN 15/6/2039	4,174,238	0.21

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,184,901	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B ' Series 2006-B A5 ' FRN 15/12/2039	3,106,504	0.16
USD 1,883,367	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A ' Series 2007-A A4A ' FRN 16/12/2041	1,847,110	0.10
USD 1,900,000	SLM Private Education Loan Trust 2010-C ' Series 2010-C A5 ' ' 144A ' FRN 15/10/2041	2,117,034	0.11
USD 812,193	SLM Private Education Loan Trust 2011-B ' Series 2011-B A3 ' ' 144A ' FRN 16/6/2042	817,157	0.04
USD 12,090	SLM Private Education Loan Trust 2011-C ' Series 2011-C A2B ' ' 144A ' 4.54% 17/10/2044	12,104	0.00
USD 1,231,866	SLM Student Loan Trust 2013-4 ' Series 2013-4 A ' FRN 25/6/2043	1,224,054	0.06
USD 1,517,305	SMB Private Education Loan Trust 2015-C ' Series 2015-C A2A ' ' 144A ' 2.75% 15/7/2027	1,536,467	0.08
USD 1,391,883	SMB Private Education Loan Trust 2016-A ' Series 2016-A A2A ' ' 144A ' 2.7% 15/5/2031	1,418,589	0.07
USD 1,636,372	SMB Private Education Loan Trust 2016-B ' Series 2016-B A2A ' ' 144A ' 2.43% 17/2/2032	1,659,013	0.09
USD 3,930,602	SMB Private Education Loan Trust 2017-A ' Series 2017-A A2B ' ' 144A ' FRN 15/9/2034	3,941,590	0.20
USD 2,150,000	SMB Private Education Loan Trust 2019-A ' Series 2019-A A2A ' ' 144A ' 3.44% 15/7/2036	2,282,052	0.12
USD 5,880,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A ' Series 2020-A A1 ' ' 144A ' FRN 15/3/2027	5,866,072	0.30
USD 680,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A ' Series 2020-A A2B ' ' 144A ' FRN 15/9/2037	679,486	0.03
USD 2,406,441	SoFi Professional Loan Program 2015-d LLC ' Series 2015-D A2 ' ' 144A ' 2.72% 27/10/2036	2,432,384	0.13
USD 943,749	Sofi Professional Loan Program 2016-A LLC ' Series 2016-A A2 ' ' 144A ' 2.76% 26/12/2036	954,616	0.05
USD 634,984	SoFi Professional Loan Program 2016-C LLC ' Series2016-C A2B ' ' 144A ' 2.36% 27/12/2032	642,235	0.03
USD 617,416	SoFi Professional Loan Program 2016-D LLC ' Series2016-D A2B ' ' 144A ' 2.34% 25/4/2033	623,606	0.03
USD 3,717,529	Sofi Professional Loan Program 2016-E LLC ' Series 2016-E A2B ' ' 144A ' 2.49% 25/1/2036	3,750,796	0.19
USD 17,977,294	SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC ' Series2017-D A2FX ' ' 144A ' 2.65% 25/9/2040	18,338,146	0.94
USD 1,701,169	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust ' Series 2018-B A1FX ' ' 144A ' 2.64% 25/8/2047	1,704,223	0.09
USD 4,425,000	Sofi Professional Loan Program 2018-C Trust ' Series 2018-C A2FX ' ' 144A ' 3.59% 25/1/2048	4,679,615	0.24
USD 4,375,000	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust ' Series 2018-D A2FX ' ' 144A ' 3.6% 25/2/2048	4,589,564	0.24
USD 75,344	Soundview Home Loan Trust 2003-2 ' Series 2003-2 A2 ' FRN 25/11/2033	76,253	0.00
USD 2,480,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	2,536,631	0.13
USD 2,197,000	South Carolina Public Service Authority 3.722% 1/12/2023	2,335,708	0.12
USD 620,000	Spectra Energy Partners LP 4.75% 15/3/2024	685,816	0.04
USD 4,705,000	Springleaf Funding Trust 2015- B ' Series 2015-BA A ' ' 144A ' 3.48% 15/5/2028	4,732,064	0.24
USD 2,625,000	Springleaf Funding Trust 2017- A ' Series 2017-AA A ' ' 144A ' 2.68% 15/7/2030	2,638,234	0.14

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
（続き）

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国（続き）		
USD 404,688	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC ' 144A ' 3.36% 20/9/2021	408,471	0.02
USD 2,975,000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC ' 144A ' 4.738% 20/3/2025	3,174,578	0.16
EUR 655,000	Stryker Corp 0.25% 3/12/2024	722,209	0.04
EUR 485,000	Stryker Corp 1.125% 30/11/2023	553,651	0.03
USD 390,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.875% 15/1/2023	395,045	0.02
USD 1,140,000	Synchrony Financial 2.85% 25/7/2022	1,165,467	0.06
USD 2,034,740	Towd Point Mortgage Trust 2016-3 ' Series 2016-3 A1 ' ' 144A ' FRN 25/4/2056	2,049,625	0.11
USD 2,830,794	Towd Point Mortgage Trust 2016-4 ' Series 2016-4 A1 ' ' 144A ' FRN 25/7/2056	2,847,429	0.15
USD 2,500,000	Toyota Auto Receivables 2018- C Owner Trust ' Series 2018- C A4 ' 3.13% 15/2/2024	2,593,444	0.13
EUR 910,000	Toyota Motor Credit Corp 2.375% 1/2/2023	1,073,122	0.06
USD 1,750,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd ' Series 2017-1A B ' ' 144A ' FRN 25/7/2029	1,742,038	0.09
USD 290,000	Truist Financial Corp 2.7% 27/1/2022	295,931	0.02
USD 2,900,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C1 ' Series 2017- C1 A4 ' 3.46% 15/6/2050	3,194,563	0.16
USD 1,595,000	Union Pacific Corp 2.15% 5/2/2027	1,614,734	0.08
USD 20,295,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.25% 15/7/2029	21,501,872	1.11
USD 13,000,000	United States Treasury Note/ Bond 1.375% 30/9/2020*	13,010,156	0.67
USD 45,335,000	United States Treasury Note/ Bond 1.375% 15/10/2022	45,880,437	2.36
USD 5,000,000	United States Treasury Note/ Bond 1.375% 15/2/2023	5,068,945	0.26
USD 10,100,000	United States Treasury Note/ Bond 1.5% 15/8/2022	10,245,582	0.53
USD 52,270,000	United States Treasury Note/ Bond 1.5% 15/9/2022 †	53,054,050	2.73
USD 63,400,000	United States Treasury Note/ Bond 1.5% 15/1/2023	64,462,446	3.32
USD 20,000,000	United States Treasury Note/ Bond 1.75% 31/10/2020	20,070,703	1.03
USD 18,000,000	United States Treasury Note/ Bond 2% 30/11/2020	18,112,852	0.93
USD 63,500,000	United States Treasury Note/ Bond 2% 15/1/2021	63,978,730	3.29
USD 45,000,000	United States Treasury Note/ Bond 2.5% 31/12/2020*	45,506,250	2.34
EUR 705,000	United Technologies Corp 1.125% 15/12/2021	787,222	0.04
EUR 1,180,000	United Technologies Corp 1.15% 18/5/2024*	1,344,913	0.07
EUR 525,000	United Technologies Corp 1.25% 22/5/2023	597,268	0.03
USD 2,295,000	United Technologies Corp 3.65% 16/8/2023	2,462,882	0.13
EUR 410,000	Verizon Communications Inc 0.5% 2/6/2022	456,171	0.02
USD 2,300,000	Verizon Communications Inc 3.376% 15/2/2025	2,470,324	0.13
USD 2,745,000	Verizon Communications Inc 3.5% 1/11/2024	2,949,789	0.15
USD 2,000,000	Verizon Communications Inc 3.875% 8/2/2029	2,280,604	0.12
USD 905,000	ViacomCBS Inc 2.5% 15/2/2023	922,691	0.05
USD 2,930,000	ViacomCBS Inc 2.9% 1/6/2023	3,025,258	0.16
USD 70,000	ViacomCBS Inc 3.375% 1/3/2022	71,987	0.00
USD 965,000	ViacomCBS Inc 3.875% 1/4/2024	1,032,329	0.05
USD 800,000	ViacomCBS Inc 4.25% 1/9/2023	860,714	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 500,000	ViacomCBS Inc 4.5% 1/3/2021	513,639	0.03
USD 430,000	Volkswagen Group of America Finance LLC ' 144A ' 2.7% 26/9/2022	438,963	0.02
USD 2,379,250	Voya CLO 2014-3 Ltd ' Series 2014-3A A1R ' ' 144A ' FRN 25/7/2026	2,379,424	0.12
USD 735,000	Waste Management Inc 2.95% 15/6/2024	773,387	0.04
USD 2,300,000	WEC Energy Group Inc 3.375% 15/6/2021	2,351,557	0.12
USD 2,825,000	Wells Fargo & Co 2.5% 4/3/2021	2,849,955	0.15
USD 1,195,000	Wells Fargo & Co 3.069% 24/1/2023	1,225,140	0.06
USD 3,215,000	Wells Fargo & Co 3.75% 24/1/2024	3,436,738	0.18
USD 8,000,000	Wells Fargo Bank NA FRN 23/7/2021	8,052,015	0.41
USD 3,496,376	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 ' Series 2014-LC16 ASB ' 3.477% 15/8/2050	3,628,472	0.19
USD 500,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22 ' Series 2015-LC22 ASB ' 3.571% 15/9/2058	527,777	0.03
USD 1,579,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 ' Series 2015-NXS1 A5 ' 3.148% 15/5/2048	1,680,565	0.09
USD 3,438,623	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C8 ' Series 2012- C8 AFL ' ' 144A ' FRN 15/8/2045	3,452,898	0.18
USD 4,886,549	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 ' Series 2014- C21 ASB ' 3.393% 15/8/2047	5,033,723	0.26
USD 58,670	Wheels SPV 2 LLC ' Series 2017-1A A2 ' ' 144A ' 1.88% 20/4/2026	58,754	0.00
USD 2,400,000	Williams Cos Inc/The 3.7% 15/1/2023	2,499,393	0.13
USD 1,765,000	Williams Cos Inc/The 4% 15/11/2021	1,822,760	0.09
USD 2,000,000	WRKCo Inc 3.75% 15/3/2025	2,162,681	0.11
USD 3,205,000	Xerox Corp 3.5% 20/8/2020	3,222,267	0.17
USD 719,000	ZF North America Capital Inc ' 144A ' 4.5% 29/4/2022	743,650	0.04
		1,535,618,415	79.03
債券合計		1,853,644,449	95.39
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		1,922,861,940	98.96

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
	米国 Structured Asset Receivables Trust Series 2003-2 USD 350,000 31/12/2049 **	0.649%	- 0.00
債券合計			- 0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計			- 0.00
投資有価証券合計		1,922,861,940	98.96
その他の純資産		20,330,203	1.04
純資産合計(米ドル)		1,943,192,143	100.00

† 差入れた有価証券または保証として引渡した有価証券。詳細については注記14を参照のこと。

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

** 注記2(j)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

未決済上場先物取引 2020年2月29日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
117	AUD	Australian 10 Year Bond	2020年3月	432,684
(4)	EUR	Euro Bund	2020年3月	(26,936)
(226)	EUR	Euro Schatz	2020年3月	(99,456)
(289)	EUR	Euro BOBL	2020年3月	(437,231)
4,000	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2020年6月	6,609,162
(46)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2020年6月	(397,759)
(68)	USD	US Long Bond (CBT)	2020年6月	(391,335)
(149)	USD	US Ultra 10 Year Note	2020年6月	(358,751)
(507)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2020年6月	(916,969)
(1,334)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2020年6月	(1,316,893)
合計				3,096,516

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2020年2月29日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	8,540	1,254
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(2,996)	(2,031)
CDS	USD 18,619,200	ファンドはCDX.NA.HY.29.V5に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2022	226,367	(753,692)
CDS	USD (9,000,000)	ファンドはCDX.NA.IG.32.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2024	(49,156)	141,226
CDS	USD (39,055,500)	ファンドはCDX.NA.HY.33.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2024	(861,692)	1,855,173
CDS	USD (6,500,000)	ファンドはBoeing Co/Theに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2020	(4,167)	34,890
CDS	USD 842,012	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	881	(27,164)
CDS	USD (898,113)	ファンドは21st Century Fox America Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	(4,696)	26,666
CDS	USD 844,970	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	256	(27,259)
CDS	USD (788,869)	ファンドは21st Century Fox America Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	(5,553)	23,423
CDS	USD (1,767,105)	ファンドはInternational Business Machines Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	9	48,335
CDS	USD (1,791,844)	ファンドはInternational Business Machines Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	(1,671)	49,012
CDS	USD (2,120,526)	ファンドはInternational Business Machines Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	(3,984)	58,002
CDS	USD (144,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V5に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/12/2022	(4,629)	5,829
CDS	USD (3,555,000)	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2024	219,292	(39,527)
CDS	USD (8,640,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V5に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2022	(332,147)	349,741

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (9,835,200)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V5に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	20/12/2022	(186,526)	398,122
CDS	USD (100,000)	ファンドはCDX.NA.IG.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	(748)	1,445
CDS	USD 1,800,000	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	(15,653)	(15,468)
CDS	USD (2,120,525)	ファンドはInternational Business Machines Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	(8,816)	58,002
CDS	USD (1,800,000)	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	22,995	(55,934)
CDS	USD (1,248,409)	ファンドはApache Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	6,597	(38,794)
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(1,655)	(1,254)
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	10,067	2,031
CDS	USD (5,000,000)	ファンドはInternational Business Machines Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2024	188	133,520
CDS	USD 400,000	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(3,410)	8,405
CDS	USD 1,750,000	ファンドはAllstate Corp/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	931	(55,587)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはPfizer Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	1,442	(49,789)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはLowe's Companies Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(11,675)	(54,114)
IRS	USD 32,480,000	ファンドはUSD 1日LIBORの変動金利を受け取り、1.27654%の固定金利を支払う	Bank of America	15/12/2021	(302,933)	(302,933)
IRS	USD 32,480,000	ファンドはUSD 1日LIBORの変動金利を受け取り、1.28395%の固定金利を支払う	Bank of America	15/12/2021	(307,037)	(307,037)
IRS	USD 94,360,000	ファンドはUSD 1日LIBORの変動金利を受け取り、1.40083%の固定金利を支払う	Bank of America	15/12/2021	(1,080,082)	(1,080,082)
IRS	USD 4,470,000	ファンドはUSD 1日LIBORの変動金利を受け取り、1.12%の固定金利を支払う	Bank of America	31/8/2024	(74,971)	(75,142)

スワップ 2020年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 27,400,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.323%の固定金利を支払う	Bank of America	31/8/2024	(457,943)	(462,124)
IRS	USD 18,140,000	ファンドは1.37%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2027	438,790	436,224
IRS	USD 12,940,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.44%の固定金利を支払う	Bank of America	15/11/2029	(417,376)	(414,219)
IRS	USD 8,560,000	ファンドは1.562%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2036	430,653	427,988
IRS	USD 3,040,000	ファンドは1.627%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/11/2045	236,312	234,625
IRS	USD 37,040,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.135%の固定金利を支払う	Barclays	31/8/2020	68,053	68,053
合計					(2,468,143)	599,816

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2020年2月29日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	539,878	EUR	494,000	JP Morgan	4/3/2020	(1,965)
USD	123,099,774	EUR	111,480,000	Bank of America	4/3/2020	823,175
USD	1,743,113	EUR	1,576,000	Morgan Stanley	4/3/2020	14,481
USD	1,028,043	EUR	925,000	Goldman Sachs	4/3/2020	13,459
USD	1,582,751	GBP	1,216,000	Citibank	4/3/2020	23,430
USD	2,274,678	GBP	1,745,000	State Street	4/3/2020	37,001
USD	23,055,579	GBP	17,681,000	BNP Paribas	4/3/2020	382,590
AUD	14,050,000	NZD	14,678,810	Bank of America	18/3/2020	(11,981)
CAD	6,290,000	NOK	42,392,084	Morgan Stanley	18/3/2020	207,638
CAD	12,720,000	NOK	86,886,523	JP Morgan	18/3/2020	297,667
NOK	42,718,063	CAD	6,290,000	Morgan Stanley	18/3/2020	(173,254)
NOK	43,588,610	CAD	6,360,000	JP Morgan	18/3/2020	(133,501)
NOK	43,763,160	CAD	6,360,000	Bank of America	18/3/2020	(115,090)
NOK	87,500,000	SEK	90,725,436	Morgan Stanley	18/3/2020	(91,292)
NZD	7,243,216	AUD	7,010,000	Bank of America	18/3/2020	(44,274)
NZD	7,381,915	AUD	7,040,000	JP Morgan	18/3/2020	22,754
SEK	45,507,706	NOK	43,900,000	Deutsche Bank	18/3/2020	44,719
SEK	45,457,534	NOK	43,600,000	Morgan Stanley	18/3/2020	71,209
USD	6,361,449	MXN	124,818,564	RBS Plc	2/4/2020	64,060
USD	146,802	MXN	2,881,436	HSBC Bank Plc	2/4/2020	1,427
USD	484,358	EUR	445,000	State Street	3/4/2020	(4,648)
USD	304,483	EUR	281,000	Goldman Sachs	3/4/2020	(4,305)
USD	125,864,690	EUR	114,475,000	UBS	3/4/2020	69,198
USD	1,839,799	GBP	1,425,000	Citibank	3/4/2020	10,923
USD	26,508,257	GBP	20,552,000	RBS Plc	3/4/2020	131,379
未実現純評価益						1,634,800
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	304,715,867	USD	333,121,152	BNY Mellon	13/3/2020	1,291,928
USD	989,375	EUR	912,832	BNY Mellon	13/3/2020	(12,414)
未実現純評価益						1,279,514
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	537,038	USD	387,209	BNY Mellon	13/3/2020	(2,359)
未実現純評価損						(2,359)
未実現純評価益合計						2,911,955

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

事後通告証券契約 2020年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD 5,250,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2 3/20 ' 2% TBA	5,288,759	0.27
USD 32,302,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2.5 3/20 ' 2.5% TBA	33,006,082	1.70
USD 19,353,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3 3/20 ' 3% TBA	19,983,484	1.03
USD 5,855,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4 3/20 ' 4% TBA	6,134,374	0.31
USD 5,000,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4.5 3/20 ' 4.5% TBA	5,182,132	0.27
T B A 合計		69,594,831	3.58

事後通告(以下「T B A」という。)契約は、主にパス・スルー代理人の発行体の所在国により分類される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2020年12月末現在)

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

資産総額	1,606,061,706円
負債総額	35,018,586円
純資産総額(-)	1,571,043,120円
発行済数量	1,676,394,875口
1 単位当たり純資産額(/)	0.9372円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1 受益証券の名義書換え等
該当事項はありません。

2 受益者名簿の閉鎖の時期
受益者名簿は作成していません。

3 投資者に対する特典
該当事項はありません。

4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
譲渡制限は設けておりません。

5 受益証券の再発行
投資者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

6 受益権の譲渡
投資者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
前項の申請のある場合には、の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

7 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

8 受益権の再分割
委託会社は、受益権の再分割を行いません。ただし、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

9 償還金
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（償還日以前において換金が行なわれた受益権に係る投資者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）に支払います。なお、当該投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、換金の受付、換金代金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に当たって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減

2017年12月7日付で、資本金を2,435百万円から3,120百万円に増額しました。

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

株主により構成される会社における最高の意思決定機関として、取締役の選任、利益処分の承認、定款の変更等、会社法および定款の定めにしたがって重要事項の決定を行ないます。

<取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

<エグゼクティブ委員会他各委員会>

当社における適切な経営戦略の構築、業務執行体制の構築および業務運営の推進を目的として、エグゼクティブ委員会を設置します。また、その他各種委員会を設置し、業務の能率的運営および責任体制の確立を図っています。

運用の意思決定機構

投資委員会

・投資委員会にて運用にかかる投資方針、パフォーマンスおよびリスク管理に関する重要事項を審議します。

運用担当部署

・各運用担当部署では、投資委員会の決定にしたがい、ファンドの個別の運用計画を策定し、各部署の投資プロセスを通して運用を行ないます。

ポートフォリオ・マネジャー

・ポートフォリオ・マネジャーは、策定された運用計画に基づき、個別銘柄を選択し売買に関する指図を行ないます。

リスク管理

・委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行なっております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行なっております。

2【事業の内容及び営業の概況】

投信法に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務、第一種金融商品取引業務および第二種金融商品取引業務等を行なっています。

委託会社の運用する証券投資信託は2020年12月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。)

種類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	170	9,603,509
単位型株式投資信託	34	304,920
合計	204	9,908,429

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社(以下「当社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(1963年大蔵省令第59号。)第2条及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」(2007年8月6日内閣府令第52号。)に基づいて作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度(自2019年1月1日 至2019年12月31日)の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

3．財務諸表に記載している金額については、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

		第32期 (2018年12月31日現在)	第33期 (2019年12月31日現在)
資産の部			
流動資産			
現金・預金		23,891	20,388
立替金		2	26
前払費用		151	175
未収入金	2	11	30
未収委託者報酬		1,588	1,696
未収運用受託報酬		2,291	2,268
未収収益	2	1,402	1,832
その他流動資産		18	0
流動資産計		29,359	26,418
固定資産			
有形固定資産			
建物附属設備	1	1,484	1,240
器具備品	1	380	475
有形固定資産計		1,864	1,716
無形固定資産			
ソフトウェア		8	5
無形固定資産計		8	5
投資その他の資産			
投資有価証券		11	49
長期差入保証金		1,119	1,120
前払年金費用		696	800
長期前払費用		27	45
繰延税金資産		848	824
投資その他の資産計		2,702	2,839
固定資産計		4,575	4,561
資産合計		33,935	30,980

	第32期 (2018年12月31日現在)	第33期 (2019年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	97	94
未払金	2	
未払収益分配金	4	4
未払償還金	74	74
未払手数料	515	487
その他未払金	1,184	985
未払費用	2	
未払消費税等	97	117
未払法人税等	440	363
為替予約	3	-
前受金	78	97
賞与引当金	1,939	2,017
役員賞与引当金	142	139
早期退職慰労引当金	42	10
流動負債計	5,661	5,493
固定負債		
退職給付引当金	60	67
資産除去債務	781	782
固定負債計	842	850
負債合計	6,503	6,344
純資産の部		
株主資本		
資本金	3,120	3,120
資本剰余金		
資本準備金	3,001	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,847	6,847
利益剰余金		
利益準備金	336	336
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	17,127	14,330
利益剰余金合計	17,464	14,666
株主資本合計	27,432	24,634
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	1
評価・換算差額等合計	0	1
純資産合計	27,431	24,636
負債・純資産合計	33,935	30,980

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

		第32期 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	第33期 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		5,639	5,643
運用受託報酬	1	8,523	7,545
その他営業収益	1	13,511	13,290
営業収益計		27,674	26,480
営業費用			
支払手数料		1,856	1,632
広告宣伝費		191	167
調査費			
調査費		363	381
委託調査費	1	4,164	3,587
調査費計		4,528	3,968
委託計算費		84	82
営業雑経費			
通信費		59	53
印刷費		11	82
諸会費		34	43
営業雑経費計		106	178
営業費用計		6,767	6,029
一般管理費			
給料			
役員報酬		406	482
給料・手当		4,213	4,441
賞与		2,359	2,343
給料計		6,979	7,268
退職給付費用		275	308
福利厚生費		940	977
事務委託費	1	2,568	2,339
交際費		66	57
寄付金		3	2
旅費交通費		238	233
租税公課		245	257
不動産賃借料		804	875
水道光熱費		72	76
固定資産減価償却費		315	404
のれん償却額		42	-
資産除去債務利息費用		3	0
諸経費		424	312
一般管理費計		12,980	13,114
営業利益		7,926	7,335

	第32期 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	第33期 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
営業外収益		
その他	1	1
営業外収益計	1	1
営業外費用		
為替差損	26	32
固定資産除却損	-	3
その他	-	0
営業外費用計	26	36
経常利益	7,901	7,300
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	84	36
特別損失計	84	36
税引前当期純利益	7,817	7,263
法人税、住民税及び事業税	2,491	2,338
法人税等調整額	61	22
当期純利益	5,387	4,902

(3)【株主資本等変動計算書】

第32期 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

(単位:百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他有価証 券評価差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
2018年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044
当期変動額											
当期純利益						5,387	5,387	5,387			5,387
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)									0	0	0
当期変動額合計	-	-	-	-	-	5,387	5,387	5,387	0	0	5,387
2018年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	17,127	17,464	27,432	0	0	27,431

第33期 (自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)

(単位:百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他有価証 券評価差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
2019年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	17,127	17,464	27,432	0	0	27,431
当期変動額											
剰余金の配当						7,700	7,700	7,700			7,700
当期純利益						4,902	4,902	4,902			4,902
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)									1	1	1
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,797	2,797	2,797	1	1	2,795
2019年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	14,330	14,666	24,634	1	1	24,636

注 記 事 項

【重要な会計方針】

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定）を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は建物附属設備6～18年、器具備品2～15年であります。

(2) 無形固定資産

自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

のれんの償却方法については、その効果の及ぶ期間（5～9年）に基づく定額法によっております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金の計上方法

債権の貸倒損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金の計上方法

旧退職金制度

適格退職年金制度移行日現在在籍していた従業員については、旧退職金制度に基づく給付額を保証しているため、期末現在の当該給付額と年金制度に基づく給付額との差額を引当て計上しております。

確定拠出年金制度

確定拠出年金制度（DC）による退職年金制度を有しております。

確定給付年金制度

キャッシュ・バランス型の年金制度（CB）の退職年金制度を有しております。CBには、一定の利回り保証を付しており、これの将来の支払に備えるため、確定給付型の会計基準に準じた会計処理方法により引当金を計上しております。

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、ポイント基準によっております。

過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理または費用から控除することとしております。

- (3) 賞与引当金の計上方法
従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
 - (4) 役員賞与引当金の計上方法
役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
 - (5) 早期退職慰労引当金の計上方法
早期退職慰労の支払に備えて、早期退職慰労支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、期末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
- (1) 消費税等の処理方法
消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。
 - (2) 連結納税制度の適用
親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。

（未適用の会計基準等）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年3月30日）

「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2018年3月30日）

- (1) 概要
収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。
ステップ1：顧客との契約を識別する。
ステップ2：契約における履行義務を識別する。
ステップ3：取引価格を算定する。
ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ5：履行義務を充足したときに又は充足するにつれて収益を認識する。
- (2) 適用予定日
2022年12月期の期首より適用予定であります。
- (3) 当該会計基準等の適用による影響
影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年12月31日)	当事業年度 (2019年12月31日)
建物附属設備	1,525 百万円	1,769 百万円
器具備品	950 百万円	1,104 百万円

2 関係会社に対する資産及び負債

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (2018年12月31日)	当事業年度 (2019年12月31日)
未収入金	- 百万円	3 百万円
未収収益	554 百万円	917 百万円
未払金	1,168 百万円	969 百万円
未払費用	385 百万円	445 百万円

3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行2行と当座貸越契約を締結しております。これら契約に基づく事業年度末の借入未実行残高は次のとおりであります。

	前事業年度 (2018年12月31日)	当事業年度 (2019年12月31日)
当座貸越極度額	1,000 百万円	1,000 百万円
借入実行残高	-	-
差引額	1,000 百万円	1,000 百万円

（損益計算書関係）

1 関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
その他営業収益	5,680 百万円	5,554 百万円
委託調査費	704 百万円	698 百万円
事務委託費	864 百万円	954 百万円
運用受託報酬	149 百万円	225 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

	前事業年度期首	増加	減少	前事業年度末
普通株式(株)	15,000	-	-	15,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	15,000	-	-	15,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年3月28日 株主総会決議	普通株式	7,700	513,333	2018年12月31日	2019年3月29日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定し、また、資金調達については関連当事者からの長期借入に限定しています。

投資有価証券は、当社設定の投資信託であり、通常の営業過程において保有しております。

デリバティブについては、外貨建て営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。当該リスクに関しては、当社の経理規程に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行い、個別に未収債権の回収可能性を管理する体制をしいております。

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

営業債務は流動性リスクに晒されていますが、当社では資金繰計画を作成するなどの方法により管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、金額的重要性が低いものについては含めておりません。

前事業年度（2018年12月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	23,891	23,891	-
(2) 未収委託者報酬	1,588	1,588	-
(3) 未収運用受託報酬	2,291	2,291	-
(4) 未収収益	1,402	1,402	-
(5) 長期差入保証金	1,119	1,112	6
資産計	30,293	30,287	6
(1) 未払手数料	515	515	-
(2) 未払費用	1,039	1,039	-
負債計	1,554	1,554	-

当事業年度（2019年12月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	20,388	20,388	-
(2) 未収委託者報酬	1,696	1,696	-
(3) 未収運用受託報酬	2,268	2,268	-
(4) 未収収益	1,832	1,832	-
(5) 長期差入保証金	1,120	1,116	4
資産計	27,306	27,302	4
(1) 未払手数料	487	487	-
(2) 未払費用	1,102	1,102	-
負債計	1,590	1,590	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収収益

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(5) 長期差入保証金

事務所敷金の時価については、事務所の敷金を当該賃貸借契約期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。また従業員社宅敷金の時価については、平均残存勤務期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。

負 債

(1) 未払手数料、(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年12月31日）

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	23,891	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,588	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,291	-	-	-
(4) 未収収益	1,402	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	56	11
合計	29,174	1,051	56	11

当事業年度（2019年12月31日）

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	20,388	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,696	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,268	-	-	-
(4) 未収収益	1,832	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	57	11
合計	26,186	1,051	57	11

(有価証券関係)

前事業年度 (2018年12月31日)

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他 投資信託	11	12	0
合計		11	12	0

当事業年度 (2019年12月31日)

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他 投資信託	49	47	1
合計		49	47	1

(退職給付関係)

前事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、平成21年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度(確定拠出年金制度及び確定給付年金制度)を承継しました。また、平成23年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、平成23年1月1日以降、からの三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,832
勤務費用	269
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	11
退職給付の支払額	138
過去勤務費用の発生額	47
退職給付債務の期末残高	1,934

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
年金資産の期首残高	2,621
期待運用収益	23
数理計算上の差異の発生額	113
事業主からの拠出額	303
退職給付の支払額	138
年金資産の期末残高	2,696

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (2018年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,874
年金資産	2,696
非積立型制度の退職給付債務	821
	60
未積立退職給付債務	761
未認識数理計算上の差異	73
未認識過去勤務費用	52
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635
退職給付引当金	60
前払年金費用	696
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
勤務費用	269
利息費用	7
期待運用収益	23
数理計算上の差異の費用処理額	44
過去勤務費用の処理額	8
確定給付制度に係る退職給付費用合計	200
特別退職金	84
合計	285

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	前事業年度 (2018年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券77%、株式20%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
割引率	0.6%
長期期待運用収益率	1.0%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、75百万円でありました。

当事業年度（自 2019年1月1日 至 2019年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、平成21年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度（確定拠出年金制度及び確定給付年金制度）を承継しました。また、平成23年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、平成23年1月1日以降、からの三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,934
勤務費用	290
利息費用	11
数理計算上の差異の発生額	14
退職給付の支払額	204
過去勤務費用の発生額	-
退職給付債務の期末残高	2,047

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
年金資産の期首残高	2,696
期待運用収益	26
数理計算上の差異の発生額	132
事業主からの拠出額	328
退職給付の支払額	204
年金資産の期末残高	2,979

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (2019年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,979
年金資産	2,979
非積立型制度の退職給付債務	999
	67
未積立退職給付債務	931
未認識数理計算上の差異	157
未認識過去勤務費用	41
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	732
退職給付引当金	67
前払年金費用	800
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	732

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
勤務費用	290
利息費用	11
期待運用収益	26
数理計算上の差異の費用処理額	33
過去勤務費用の処理額	10
確定給付制度に係る退職給付費用合計	231
特別退職金	36
合計	267

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	当事業年度 (2019年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券76%、株式21%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
割引率	0.6%
長期期待運用収益率	1.0%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、75百万円でありました。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2018年12月31日)	当事業年度 (2019年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	167	191
賞与引当金	591	617
資産除去債務	239	239
未払事業税	83	72
早期退職慰労引当金	13	3
退職給付引当金	18	20
有形固定資産	3	1
その他	96	45
繰延税金資産合計	1,213	1,191
繰延税金負債		
退職給付引当金	213	245
資産除去債務に対応する除去費用	152	121
その他	-	0
繰延税金負債合計	365	366
繰延税金資産の純額	848	824

(注) 前事業年度及び当事業年度における繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2018年12月31日)	当事業年度 (2019年12月31日)
固定資産 - 繰延税金資産	848	824

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	前事業年度 (2018年12月31日)		当事業年度 (2019年12月31日)	
法定実効税率	30.9	%	30.6	%
(調整)				
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.0		1.9	
損金不算入ののれん償却額	0.2		-	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.1		-	
所得拡大促進税制による税額控除	1.9		-	
その他	0.8		0.0	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.1	%	32.5	%

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

当事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該定期建物賃貸借契約上の賃貸借期間約5年と見積り、割引率は0.16%~0.18%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
期首残高	262	781
有形固定資産の取得に伴う増加額	75	-
見積りの変更による増加額	440	-
時の経過による調整額	3	0
資産除去債務の履行による減少額	-	-
期末残高	781	782

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 (2018年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	164	-		3	3
	合計	164	-		3	3

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度 (2019年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	79	-		0	0
	買建 英ポンド	0	-		0	0
合計		79	-		0	0

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

前事業年度（自 2018年1月1日 至 2018年12月31日）

1. セグメント情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：百万円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,639	8,523	13,511	27,674

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位：百万円)

日本	北米	その他	合計
13,237	11,293	3,143	27,674

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位：百万円)

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	5,830	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,458	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年1月1日 至 2019年12月31日）

1. セグメント情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：百万円）

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,643	7,545	13,290	26,480

(2) 地域ごとの情報

売上高

（単位：百万円）

日本	北米	その他	合計
12,538	11,197	2,744	26,480

（注） 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

（単位：百万円）

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	5,779	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,314	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等に限る。)等

前事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	73 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用 受託報酬	149	未収収益	554
							受入 手数料	5,680		
							委託 調査費	704	未払費用	385
							事務 委託費	864	その他未払金	165
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	-	その他未払金	1,002

当事業年度(自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	73 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用 受託報酬	225	未収収益	917
							受入 手数料	5,554		
							委託 調査費	698	未払費用	445
							事務 委託費	954	その他未払金	74
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	-	未収入金	3
									その他未払金	894

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

前事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)

該当事項はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,458	未収収益	330
							委託調査費	37	未払費用	4
							事務委託費	8		

当事業年度(自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,314	未収収益	360
							委託調査費	145	未払費用	9
							事務委託費	28		

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 運用受託報酬については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (2) 受入手数料については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (3) 委託調査費については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (4) 事務委託費については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

- ブラックロック・インク(ニューヨーク証券取引所に上場)
 ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク(非上場)
 ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社(非上場)

(1株当たり情報)

項目	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
1株当たり純資産額	1,828,761 円 92 銭	1,642,418 円 94 銭
1株当たり当期純利益金額	359,180 円 40 銭	326,833 円 15 銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)	当事業年度 (自 2019年 1月 1日 至 2019年12月31日)
当期純利益 (百万円)	5,387	4,902
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	5,387	4,902
普通株式の期中平均株式数 (株)	15,000	15,000

独立監査人の監査報告書は、当事業年度(自 2019年1月1日 至2019年12月31日)を対象としております。

【中間財務諸表】

1．中間財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社（以下「当社」という。）の中間財務諸表すなわち中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（1977年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」（2007年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、中間会計期間（自2020年1月1日 至2020年6月30日）の中間財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

3．財務諸表に記載している金額については、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		中間会計期間末 (2020年6月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2	14,477
立替金		20
前払費用		189
未収入金		6
未収委託者報酬		1,585
未収運用受託報酬		1,640
未収収益		829
為替予約		1
流動資産計		18,750
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	1,120
器具備品	1	518
有形固定資産計		1,638
無形固定資産		
ソフトウェア		7
無形固定資産計		7
投資その他の資産		
投資有価証券		36
長期差入保証金		1,119
前払年金費用		849
長期前払費用		36
繰延税金資産		481
投資その他の資産計		2,523
固定資産計		4,169
資産合計		22,920

(単位:百万円)

中間会計期間末
(2020年6月30日)

負債の部	
流動負債	
預り金	117
未払金	
未払収益分配金	4
未払償還金	74
未払手数料	418
その他未払金	522
未払費用	672
未払消費税等	150
未払法人税等	279
前受金	26
賞与引当金	883
役員賞与引当金	70
流動負債計	3,221
固定負債	
退職給付引当金	68
資産除去債務	783
固定負債計	851
負債合計	4,073
純資産の部	
株主資本	
資本金	3,120
資本剰余金	
資本準備金	3,001
その他資本剰余金	3,846
資本剰余金合計	6,847
利益剰余金	
利益準備金	336
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	8,543
利益剰余金合計	8,880
株主資本合計	18,848
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1
評価・換算差額等合計	1
純資産合計	18,846
負債・純資産合計	22,920

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 2020年1月1日 至 2020年6月30日)
営業収益	
委託者報酬	2,714
運用受託報酬	3,593
その他営業収益	6,146
営業収益計	12,454
営業費用	
支払手数料	695
広告宣伝費	46
調査費	
調査費	181
委託調査費	1,687
調査費計	1,869
委託計算費	39
営業雑経費	
通信費	29
印刷費	45
諸会費	22
営業雑経費計	98
営業費用計	2,749
一般管理費	
給料	
役員報酬	425
給料・手当	2,334
賞与	1,196
給料計	3,956
退職給付費用	165
福利厚生費	498
事務委託費	1,118
交際費	11
旅費交通費	29
租税公課	137
不動産賃借料	457
水道光熱費	28
固定資産減価償却費	214
資産除去債務利息費用	0
諸経費	155
一般管理費計	6,775
営業利益	2,929

(単位:百万円)

中間会計期間

(自 2020年1月1日
至 2020年6月30日)

営業外収益	
受取利息	0
有価証券売却益	0
為替差益	17
雑益	0
営業外収益計	18
経常利益	2,947
税引前中間純利益	2,947
法人税、住民税及び事業税	690
法人税等調整額	344
中間純利益	1,913

(3) 中間株主資本等変動計算書

中間会計期間（自 2020年1月1日 至 2020年6月30日）

（単位：百万円）

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他有価 証券評価 差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
当期首残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	14,330	14,666	24,634	1	1	24,636
当中間期変動額											
剰余金の配当						7,700	7,700	7,700			7,700
中間純利益						1,913	1,913	1,913			1,913
株主資本以外の項目の当 中間期変動額（純額）									2	2	2
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	5,786	5,786	5,786	2	2	5,789
当中間期末残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	8,543	8,880	18,848	1	1	18,846

注 記 事 項

(重要な会計方針)

項 目	中間会計期間 自 2020年1月 1日 至 2020年6月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定）を採用しております。</p>
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	<p>時価法を採用しております。</p>
3. 固定資産の減価償却方法	<p>(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。 なお、主な耐用年数は建物附属設備5～18年、器具備品3～15年であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金の計上方法 債権の貸倒損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金の計上方法 旧退職金制度 適格退職年金制度移行日現在在籍していた従業員については、旧退職制度に基づく給付額を保証しているため、中間会計期間末現在の当該給付額と年金制度に基づく給付額との差額を引当て計上しております。</p> <p>確定拠出年金制度 確定拠出年金制度（DC）による退職年金制度を有しております。</p> <p>確定給付年金制度 キャッシュ・バランス型の年金制度（CB）の退職年金制度を有しております。CBには、一定の利回り保証を付しており、これの将来の支払に備えるため、確定給付型の会計基準に準じた会計処理方法により引当金を計上しております。</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、ポイント基準によっております。</p> <p>過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異は各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理または費用から控除することとしております。</p> <p>(3) 賞与引当金の計上方法 従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p>

項 目	中間会計期間 自 2020年1月 1日 至 2020年6月30日
5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	<p>(4) 役員賞与引当金の計上方法 役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(5) 早期退職慰労引当金の計上方法 早期退職慰労金の支払に備えて、早期退職慰労金支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
6. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 税抜方式によっております。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。</p>

(会計方針の変更)

中間会計期間 自 2020年1月 1日 至 2020年6月30日
<p>(金銭債権と金銭債務の相殺表示に関わる会計方針の変更)</p> <p>当社は、当社グループ会社間の債権債務を含む金銭債権及び金銭債務を従来総額で表示していましたが、グループ会社間でのマスター・ネットリング契約締結を契機に見直しを行った結果、「金融商品会計に関する実務指針」(日本公認会計士協会 会計制度委員会報告第14号)第140項に基づき、金銭債権と金銭債務を相殺表示する方が当社の財政状態をより適切に表示できると判断し、当中間会計期間から相殺表示する方法へ変更しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

中間会計期間末 2020年6月30日						
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建物附属設備</td> <td style="text-align: right;">1,889百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">1,197百万円</td> </tr> </table>	建物附属設備	1,889百万円	器具備品	1,197百万円		
建物附属設備	1,889百万円					
器具備品	1,197百万円					
<p>2 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行2行と当座貸越契約を締結しております。これら契約に基づく当中間会計期間末の借入未実行残高は次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">当座貸越極度額</td> <td style="text-align: right;">1,000百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">借入実行残高</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">差引額</td> <td style="text-align: right;">1,000百万円</td> </tr> </table>	当座貸越極度額	1,000百万円	借入実行残高	-	差引額	1,000百万円
当座貸越極度額	1,000百万円					
借入実行残高	-					
差引額	1,000百万円					

(中間損益計算書関係)

中間会計期間	
自	2020年1月 1日
至	2020年6月30日
1 減価償却実施額	
有形固定資産	213百万円
無形固定資産	1百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

中間会計期間																					
自	2020年1月 1日																				
至	2020年6月30日																				
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項																					
	<table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>前事業年度末 株式数</th> <th>当中間会計期間 増加株式数</th> <th>当中間会計期間 減少株式数</th> <th>当中間会計 期間末株式数</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>発行済株式</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td> 普通株式</td> <td>15,000</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>15,000</td> </tr> <tr> <td> 合計</td> <td>15,000</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>15,000</td> </tr> </tbody> </table>		前事業年度末 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計 期間末株式数	発行済株式					普通株式	15,000	-	-	15,000	合計	15,000	-	-	15,000
	前事業年度末 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計 期間末株式数																	
発行済株式																					
普通株式	15,000	-	-	15,000																	
合計	15,000	-	-	15,000																	
2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項 該当事項はありません。																					
3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項 該当事項はありません。																					
4. 配当に関する事項																					
(1) 配当金支払額																					
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>決議</th> <th>株式の種類</th> <th>配当金の総額 (百万円)</th> <th>1株当たり 配当額(円)</th> <th>基準日</th> <th>効力発生日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2020年3月30日 株主総会決議</td> <td>普通株式</td> <td>7,700</td> <td>513,333</td> <td>2019年12月31日</td> <td>2020年3月31日</td> </tr> </tbody> </table>	決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日	2020年3月30日 株主総会決議	普通株式	7,700	513,333	2019年12月31日	2020年3月31日								
決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日																
2020年3月30日 株主総会決議	普通株式	7,700	513,333	2019年12月31日	2020年3月31日																
(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの 該当事項はありません。																					

(金融商品関係)

中間会計期間
自 2020年1月 1日
至 2020年6月30日

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定し、また、資金調達については関連当事者からの長期借入に限定しています。

投資有価証券は、当社設定の投資信託であり、通常の営業過程において保有しております。

デリバティブについては、外貨建て営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。当該リスクに関しては、当社の経理規程に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行い、個別に未収債権の回収可能性を管理する体制をしいております。

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

営業債務は流動性リスクに晒されていますが、当社では資金繰計画を作成するなどの方法により管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年6月30日（中間期の決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	14,477	14,477	-
未収委託者報酬	1,585	1,585	-
未収運用受託報酬	1,640	1,640	-
未収収益	829	829	-
投資有価証券 その他有価証券	36	36	-
長期差入保証金	1,119	1,117	2
資産計	19,689	19,686	2
未払手数料	418	418	-
未払費用	672	672	-
負債計	1,091	1,091	-
デリバティブ取引 ヘッジ会計が適用されていない もの	1	1	-
デリバティブ計	1	1	-

(注)

金融商品の時価の算定方法に関する事項

現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未収収益

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

投資有価証券

投資有価証券は、投資信託であり、決算日の基準価格によっております。

中間会計期間 自 2020年1月 1日 至 2020年6月30日
<p>長期差入保証金</p> <p>事務所敷金の時価については、事務所の敷金を当該賃貸借契約期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。また従業員社宅敷金の時価については、平均残存勤務期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。</p> <p>但し、上記レートがマイナスとなる場合は、割引率はゼロを使用しております。</p> <p>未払手数料、未払費用</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。</p> <p>デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、()で示しております。</p>

(有価証券関係)

中間会計期間 自 2020年1月 1日 至 2020年6月30日																				
<p>その他有価証券</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;"></th> <th style="width: 15%;">種類</th> <th style="width: 15%;">中間貸借対照表 計上額</th> <th style="width: 15%;">取得原価</th> <th style="width: 15%;">差額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの</td> <td>その他 投資信託</td> <td style="text-align: center;">1</td> <td style="text-align: center;">1</td> <td style="text-align: center;">0</td> </tr> <tr> <td>貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの</td> <td>その他 投資信託</td> <td style="text-align: center;">35</td> <td style="text-align: center;">37</td> <td style="text-align: center;">1</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">合計</td> <td></td> <td style="text-align: center;">36</td> <td style="text-align: center;">38</td> <td style="text-align: center;">1</td> </tr> </tbody> </table>		種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他 投資信託	1	1	0	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他 投資信託	35	37	1	合計		36	38	1
	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額																
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他 投資信託	1	1	0																
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他 投資信託	35	37	1																
合計		36	38	1																

(資産除去債務関係)

中間会計期間 自 2020年1月 1日 至 2020年6月30日								
<p>資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの</p> <p>1. 当該資産除去債務の概要 当社事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。</p> <p>2. 当該資産除去債務の金額の算定方法 使用見込期間を当該定期建物賃貸借契約上の賃貸借期間5年と見積り、割引率は0.16%～0.18%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。</p> <p>3. 当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">期首残高</td> <td style="text-align: right;">782 百万円</td> </tr> <tr> <td>有形固定資産の取得に伴う増加額</td> <td style="text-align: right;">- 百万円</td> </tr> <tr> <td>時の経過による調整額</td> <td style="text-align: right;">0 百万円</td> </tr> <tr> <td>中間会計期間末残高</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">783 百万円</td> </tr> </table>	期首残高	782 百万円	有形固定資産の取得に伴う増加額	- 百万円	時の経過による調整額	0 百万円	中間会計期間末残高	783 百万円
期首残高	782 百万円							
有形固定資産の取得に伴う増加額	- 百万円							
時の経過による調整額	0 百万円							
中間会計期間末残高	783 百万円							

(セグメント情報等)

中間会計期間 自 2020年1月 1日 至 2020年6月30日				
1. セグメント情報 当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。				
2. 関連情報				
(1) 製品及びサービスに関する情報				
(単位：百万円)				
	委託者 報酬	運用受託 報酬	その他	合計
外部顧客 営業収益	2,714	3,593	6,146	12,454
(2) 地域に関する情報				
売上高				
(単位：百万円)				
日本	北米	その他	合計	
5,978	5,132	1,343	12,454	
(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。				
有形固定資産				
本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。				
(3) 主要な顧客に関する情報				
営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。				
(単位：百万円)				
相手先	営業収益	関連する セグメント名		
ブラックロック・ファイナンシャル・ マネジメント・インク	2,637	投資運用業		
ブラックロック・ファンド・アドバイ ザーズ	1,436	投資運用業		

(デリバティブ取引関係)

中間会計期間 自 2020年1月 1日 至 2020年6月30日					
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引					
通貨関連					
(単位：百万円)					
区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の 取引	為替予約取引 買建 米ドル	208	-	1	1
合計		208	-	1	1
(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。					

(1株当たり情報)

		中間会計期間
		自 2020年1月 1日
		至 2020年6月30日
1株当たり純資産額		1,256,452円20銭
1株当たり中間純利益		127,565円16銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		
1株当たり中間純利益の算定上の基礎		
損益計算書上の中間純利益		1,913百万円
1株当たり中間純利益の算定に		
用いられた普通株式に係る中間純利益		1,913百万円
期中平均株式数		15,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として金融商品取引法施行令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記に掲げるもののほか、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定める行為。

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

変更年月日	変更事項
2007年9月18日	証券業登録に伴う商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ証券投信投資顧問株式会社」に変更)のため、定款変更を行ないました。
2007年9月30日	商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社」に変更)のため、定款変更を行ないました。
2007年9月30日	公告の方法を変更するため、定款変更を行ないました。
2007年12月27日	事業を営むことの目的を変更するため、定款変更を行ないました。
2008年7月1日	グループ会社の1つであるパークレイズ・グローバル・インベスターズ・サービス株式会社を吸収合併し、それに伴い資本金の額を変更いたしました。
2008年7月1日	株式取扱規則に関する記述を追加するため、定款変更を行ないました。
2009年6月22日	本店所在地変更のため、定款変更を行ないました。
2009年12月2日	ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 商号変更(「ブラックロック・ジャパン株式会社」に変更)および定款変更を行ないました。
2011年4月1日	グループ会社であるブラックロック証券株式会社を吸収合併し、それに先立ち定款変更および資本金の額の変更を行ないました。
2013年10月5日	MGPA Japan LLCより不動産投資関連の事業を譲受し、それに先立ち定款変更を行ないました。
2014年12月1日	決算期を3月31日から12月31日に変更するため、定款変更を行ないました。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・名称 : 株式会社りそな銀行
- ・資本金の額 : 279,928百万円(2020年3月末現在)
- ・事業の内容 : 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<参考:再信託受託会社の概要>

- ・名称 : 株式会社日本カストディ銀行
- ・資本金 : 51,000百万円(2020年7月末現在)
- ・事業の内容 : 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
- ・再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託会社から再信託受託会社(株式会社日本カストディ銀行)へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) (2020年3月末現在)	事業の内容
藍澤証券株式会社	8,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
四国アライアンス証券株式会社*	3,000	
株式会社SBI証券	48,323	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	
楽天証券株式会社	7,495	
株式会社伊予銀行*	20,948	銀行法に基づき、銀行業を営んでおります。

* 四国アライアンス証券株式会社および株式会社伊予銀行は、換金に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、換金代金・償還金の支払いに関する事務等を行ない、新規の募集および販売の取扱いは行ないません。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

受託会社（受託者）として、ファンドの信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行ないます。

(2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、換金に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、換金代金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

1 交付目論見書の表紙等に、以下の事項を記載します。

(1) 委託会社等の情報

委託会社名

金融商品取引業者登録番号

設立年月日

資本金

当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額

「ファンドの運用の指図を行なう者である。」旨

(2) 受託会社に関する情報

受託会社名および「ファンドの財産の保管および管理を行なう者である。」旨

(3) 詳細情報の入手方法

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載します。

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間等

請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に添付されている旨

(4) 交付目論見書の使用開始日

(5) 届出の効力に関する事項

金商法第4条第1項又は第2項の規定による届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載します。

届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

(6) その他の記載事項

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号、以下「投信法」という。）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

2 交付目論見書の「投資リスク」記載箇所に金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨を記載します。

3 目論見書は別称として、「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

4 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年2月28日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	田中素子
--------------------	-------	------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	中島紀子
--------------------	-------	------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の2019年1月1日から2019年12月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2019年12月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年2月10日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの2020年6月23日から2020年12月21日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの2020年12月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月28日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山	田	信	之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	中	島	紀	子

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の2020年1月1日から2020年12月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（2020年1月1日から2020年6月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2020年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年1月1日から2020年6月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR L データは監査の対象には含まれていません。